

サテライト投資戦略ファンド（株式型）

愛称：サテラップ（株式型）

追加型投信／内外／資産複合

投資信託説明書

（請求目論見書）

2023年11月18日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

※本書は金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書です。

サテライト投資戦略ファンド（株式型）の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2023年11月17日に関東財務局長に提出しており、2023年11月18日にその届出の効力が生じております。

発行者名	:	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
代表者の役職・氏名	:	代表取締役社長 菱田 賀夫
本店の所在の場所	:	東京都港区芝公園一丁目1番1号
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	:	該当事項はありません。

目次

第一部【証券情報】	1
（1）【ファンドの名称】	1
（2）【内国投資信託受益証券の形態等】	1
（3）【発行（売出）価額の総額】	1
（4）【発行（売出）価格】	1
（5）【申込手数料】	1
（6）【申込単位】	1
（7）【申込期間】	2
（8）【申込取扱場所】	2
（9）【払込期日】	2
（10）【払込取扱場所】	2
（11）【振替機関に関する事項】	2
（12）【その他】	2
第二部【ファンド情報】	4
第1【ファンドの状況】	4
1【ファンドの性格】	4
2【投資方針】	13
3【投資リスク】	57
4【手数料等及び税金】	61
5【運用状況】	67
第2【管理及び運営】	104
1【申込（販売）手続等】	104
2【換金（解約）手続等】	105
3【資産管理等の概要】	107
4【受益者の権利等】	111
第3【ファンドの経理状況】	112
1【財務諸表】	115
2【ファンドの現況】	349
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	354
第三部【委託会社等の情報】	355
第1【委託会社等の概況】	355
1【委託会社等の概況】	355
2【事業の内容及び営業の概況】	356
3【委託会社等の経理状況】	356
4【利害関係人との取引制限】	378
5【その他】	378
約款	

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

サテライト投資戦略ファンド（株式型）

愛称として「サテラップ（株式型）」という名称を用いることがあります。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

①追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

②三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」といいます。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

③当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(3)【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額（※）とします。

※「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。基準価額につきましては、販売会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8) 申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

(5)【申込手数料】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に、3.3%（税抜 3.0%）（※）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

申込手数料の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8) 申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

※「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。

(6)【申込単位】

販売会社が定める単位とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8) 申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は1円以上1円単位です。

(7) 【申込期間】

2023年11月18日から2024年5月17日までとします。

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されま
す。

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

取得申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込みに係る金額を販売会社に支払うものとします。
継続申込みに係る発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、委託会社の指定する
口座を経由して、三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」又は「受託者」ということがあります。）
の指定する当ファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

取得申込みを受け付けた販売会社とします。販売会社の詳細につきましては、上記「(8) 申込取扱場所」
に記載の照会先までお問い合わせください。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

<振替受益権について>

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替
機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。

当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11) 振替機関に関する事項」に記
載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

<受益権の取得申込みの方法>

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

<申込みコース>

「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。

販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

<受益権の取得申込みの受付の中止等>

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

<受付不可日>

分配金再投資コースの収益分配金の再投資の場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

上限 3,000 億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

一般社団法人投資信託協会が定める分類方法における、当ファンドの商品分類及び属性区分は下記の通りです。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
追加型	海外	債券	MR F	特殊型
	内外	不動産投信	E T F	
		その他資産 ()		
		資産複合		

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス	特殊型
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回	グローバル (日本を含む)	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり (部分ヘッジ)	日経225 TOPIX	ブル・ベア型 条件付運用型
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年4回 年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	日本 北米 欧州 アジア オセアニア		なし	その他 ()	ロング・ショート型/絶対 収益追求型 その他 ()
不動産投信	その他 ()	中南米				
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式、不動産投信、その他資産)資産配分変更))		アフリカ 中近東 (中東) エマージング				
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型						

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

※属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) でもご覧いただけます。

◆一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。

<商品分類表定義>

[単位型投信・追加型投信の区分]

- (1) 単位型投信…当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われぬファンドをいう。
- (2) 追加型投信…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

[投資対象地域による区分]

- (1) 国内…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 海外…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 内外…目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

- (1) 株式…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 債券…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 不動産投信(リート)…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

[独立した区分]

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2) MRF(マネー・リザーブ・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3) ETF…投資信託及び投資法人に関する法律施行令(平成12年政令480号)第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法(昭和32年法律第26号)第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

[補足分類]

- (1) インデックス型…目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 特殊型…目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

<属性区分表定義>

[投資対象資産による属性区分]

(1) 株式

- ①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。
- ②大型株…目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。
- ③中小型株…目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2) 債券

- ①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。
- ②公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- ③社債…目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- ④その他債券…目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- ⑤格付等クレジットによる属性…目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3) 不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

(5) 資産複合…以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

- ①資産配分固定型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。
- ②資産配分変更型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

[決算頻度による属性区分]

- (1) 年1回…目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
- (2) 年2回…目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
- (3) 年4回…目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。
- (4) 年6回(隔月)…目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。
- (5) 年12回(毎月)…目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
- (6) 日々…目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。
- (7) その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

- (1) グローバル…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
- (2) 日本…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

- (3) 北米…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) 欧州…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5) アジア…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6) オセアニア…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7) 中南米…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8) アフリカ…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9) 中近東(中東)…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10) エマージング…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

- (1) ファミリーファンド…目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
- (2) ファンド・オブ・ファンズ…「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

[為替ヘッジによる属性区分]

- (1) 為替ヘッジあり…目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
- (2) 為替ヘッジなし…目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

- (1) 日経 225
- (2) TOPIX
- (3) その他の指数…前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[特殊型]

- (1) ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3) ロング・ショート型/絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4) その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

◆ESG 分類：当ファンドは ESG 投信ではありません。

＜ファンドの特色＞

1. 世界の株式等の収益源泉を多面的に捉えた分散投資を行い、中期的な世界経済の成長果実を積極的に捉えます。

●投資対象ファンドを通じて、主として相対的に高い収益が期待できる国内外の株式等*1に分散投資を行い、積極的に世界経済の成長果実を享受することを目指します。

*1 株式等にはリート等の株式の代替資産も含まれます。

●リート(不動産投資信託)

投資者から集めた資金で不動産への投資を行い、そこから得られる賃貸料収入や不動産の売買益を原資として投資者に配当する商品です。

2. 短期的な下振れリスクにも配慮した運用を目指します。

●投資対象ファンドを通じてヘッジファンド*2等にも投資することで、短期的な市場の下振れリスクに伴う保有資産の価値の減少を抑制し、ポートフォリオの収益の安定化を目指します。

*2 実質的に金利、為替、株式、債券、商品等に対して裁定取引やデリバティブ取引等の様々な手法を活用してリスクを回避しながら利益を追求するファンドを指します。

3. 市場環境の変化に対応して、適切なポートフォリオへ見直します。

●各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の値動きの関係(相関関係)、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性及び景気・金融政策等を中心とする投資環境の局面判断等をもとに決定します。また、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合の定期的な見直しを行うほか、市場環境等の変化に応じた調整を行います。

当ファンドの運用について

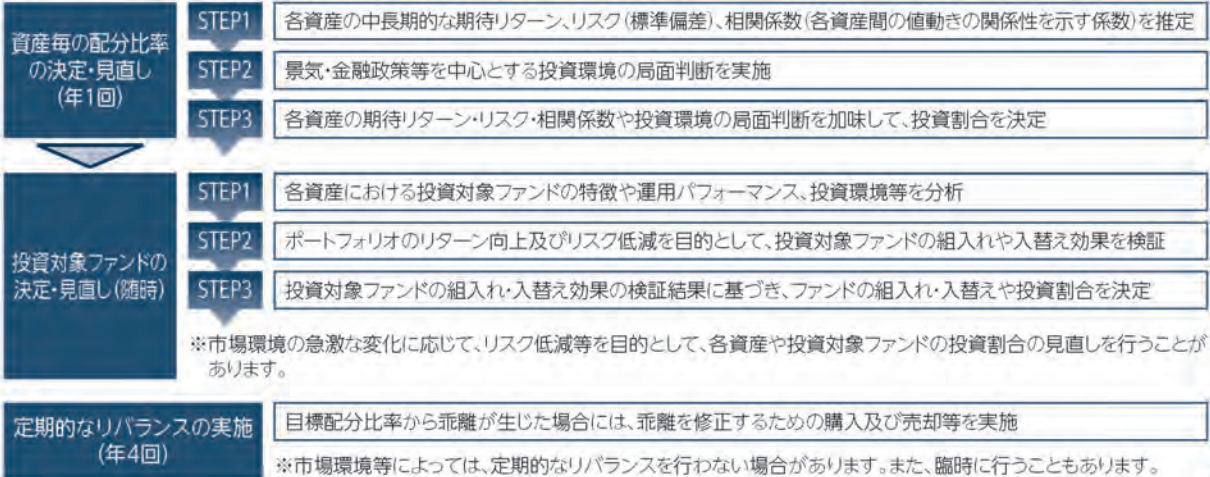
当ファンドは中期的に収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、投資対象とする資産及びファンドを限定していません。また、それらへの投資割合もあらかじめ定めているものでもありません。運用者の判断に基づき、投資対象とする資産やファンドの追加・除外、またそれらへの投資割合の変更を行います。

当ファンドの投資対象ファンドの選定について

投資対象となる運用商品の見極め(デューデリジェンス)や組み入れ後のモニタリング等は、機関投資家ニーズの多様化・高度化に対応してきた三井住友信託銀行株式会社のノウハウをもとに行います。

ポートフォリオ構築プロセス

●運用に当たっては三井住友信託銀行から投資助言を受けます。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



※投資対象ファンドの概要につきましては、後掲「2 投資方針 (2) 投資対象 (参考)投資対象ファンドの概要」をご参照ください。

? ファンド・オブ・ファンズ方式とは

投資者の皆様からお預かりした資金を、直接株式や債券といった資産に投資するのではなく、株式や債券等に投資している複数の投資信託に投資して運用を行う仕組みです。

分配方針

- 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。
ただし、分配を行わないことがあります。
 - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- 株式への直接投資は行いません。
- 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- デリバティブの直接利用は行いません。

資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

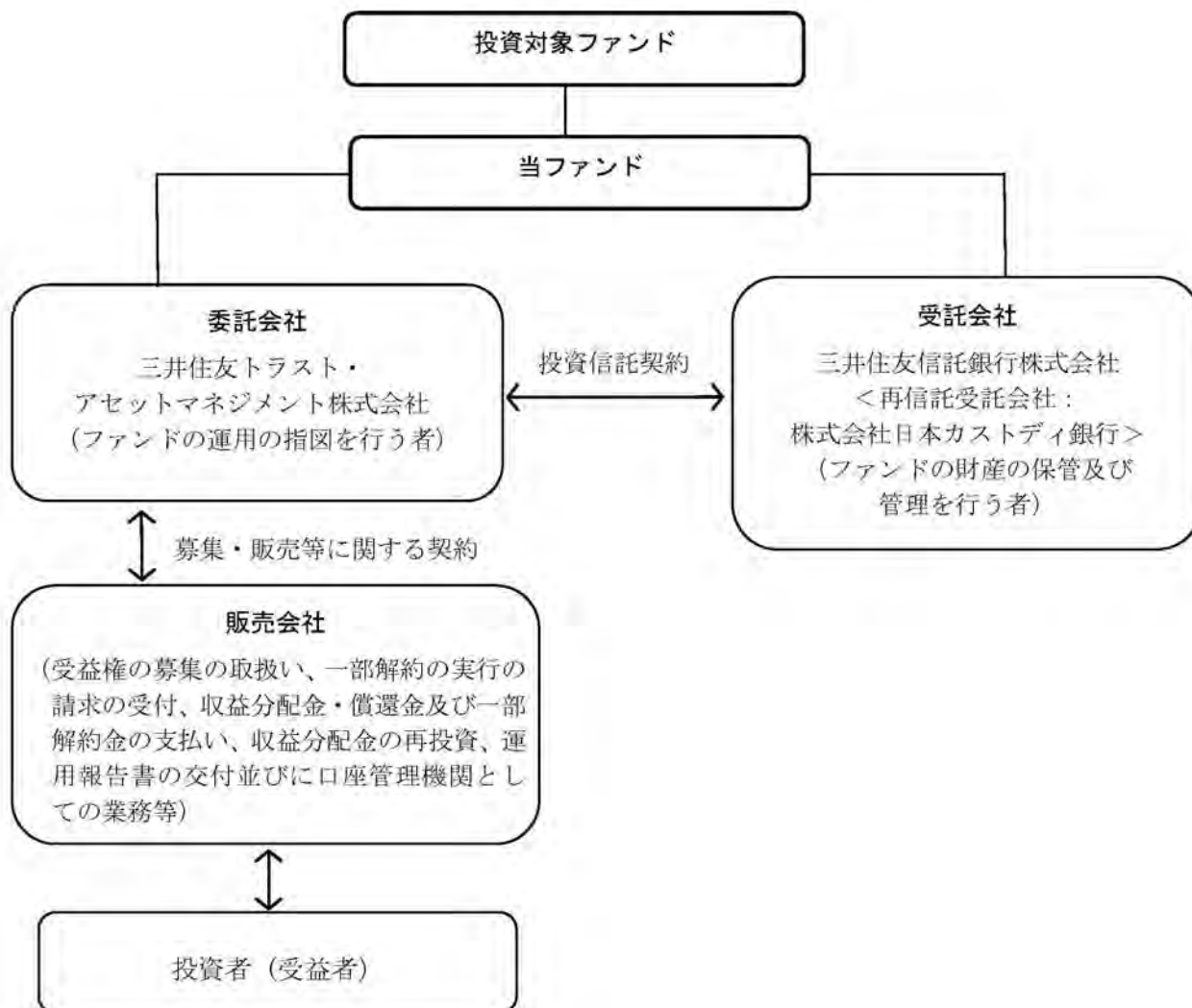
(2) 【ファンドの沿革】

2015年 6月 16日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況 (2023年 9月 29日現在)

イ. 資本金の額: 20億円

ロ. 委託会社の沿革

- 1986年 11月 1日: 住信キャピタルマネジメント株式会社設立
- 1987年 2月 20日: 投資顧問業の登録
- 1987年 9月 9日: 投資一任契約に係る業務の認可
- 1990年 10月 1日: 住信投資顧問株式会社に商号変更
- 1999年 2月 15日: 住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 1999年 3月 25日: 証券投資信託委託業の認可
- 2007年 9月 30日: 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録 (登録番号: 関東財務局長 (金商) 第 347号)
- 2012年 4月 1日: 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 2018年 10月 1日: 三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継

ハ. 大株主の状況

株 主 名	住 所	持株数	持株比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目 4 番 1 号	3,000 株	100%

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

①基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。なお、投資対象とするファンドは、当該ファンドの投資対象資産及び投資手法等を考慮して選定しております。

②投資対象

別に定める投資信託証券（以下「投資対象ファンド」という場合があります。）を主要投資対象とします。このほか、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等に直接投資する場合があります。

③投資態度

イ. 主として、日本を含む先進国及び新興国の株式、株式代替資産*¹ 及びその他の様々な資産並びにヘッジファンドを実質的な投資対象とする投資対象ファンド*² に分散投資します。

*1：この投資信託において、株式代替資産とは、不動産投資信託証券（REIT）、マスター・リミテッド・パートナーシップ（MLP）、転換社債（CB）、その他上場有価証券、その他委託会社が株式と一定程度の類似性があると判断する資産等を指します。

*2：ヘッジファンドを実質的な投資対象とする投資対象ファンドとは、実質的に金利、債券、株式、リート、為替、コモディティ等に対する裁定取引やデリバティブ取引等を積極的に活用するファンド、又は各種ヘッジファンド指数に概ね連動する投資成果を目標とするファンドを指します。

ロ. 各資産及び各投資対象ファンドへの配分比率は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の相関係数、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。各資産及び各投資対象ファンドへの配分比率は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて変更を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。

ハ. 投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、投資対象ファンドとして定められていた投資信託証券が投資対象ファンドから除外されること、もしくは新たな投資信託証券が投資対象ファンドとして定められることがあります。

ニ. 投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

ホ. この投資信託では原則として為替ヘッジを行いません。ただし、外貨建資産について為替ヘッジを行う投資信託証券を組み入れる場合があります。

ヘ. 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

(2) 【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

イ. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 1 項で定めるものをいいます。以下同じ。）

1. 有価証券
 2. 金銭債権
 3. 約束手形
- ロ. 次に掲げる特定資産以外の資産
1. 為替手形

②有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券に投資するほか、次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. コマーシャル・ペーパー及び短期社債等
2. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前号の証券の性質を有するもの
3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）
4. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、第3号の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

③金融商品の指図範囲

イ. 委託会社は、信託金を、上記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

ロ. 上記②の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ. に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

④当ファンドが、当ファンドの純資産総額の10%を超えて投資する可能性のある投資対象ファンドの概要は、下記「(参考) 投資対象ファンドの概要」に記載されている通りです。

(参考) 投資対象ファンドの概要

- ・全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。
- ・投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。

以下の内容は、2023年9月29日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

なお、投資対象ファンドの運用会社より確認した情報をもとにしており、記載している定義は、当該ファンドに限定されます。

1. FOF s 用国内株式エンハンス運用戦略ファンド (適格機関投資家専用)

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	国内株式エンハンス運用戦略マザーファンド (以下「マザーファンド」といいます。) 受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主として、マザーファンド受益証券を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式 (これに準ずるものを含みます。) に投資を行ない、東証株価指数の動きを上回る投資成果を目指して運用を行ないます。</p> <p>マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。</p> <p>株式以外の資産への実質投資割合 (マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。) は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。</p> <p>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①株式 (新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。) への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>②投資信託証券 (マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。) への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</p> <p>③外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>④デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>⑤一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</p>
ベンチマーク	TOPIX (東証株価指数) (※)
決算日	年1回: 2月15日 (休業日の場合は翌営業日)
収益の分配	<p>①分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益 (評価益を含みます。) 等の全額とします。</p> <p>②分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただ</p>

	し、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。 ③留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行いません。
信託報酬	純資産総額に対し、年率 0.374% (税抜 0.34%)
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2015 年 1 月 30 日
信託期間	2015 年 1 月 30 日から 2025 年 2 月 17 日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「TOPIX (東証株価指数)」とは、株式会社 J P X 総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社 (以下「J P X」という。) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。

2. 中小型株式 マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の中小型株式を主要な投資対象とし、投資信託財産の中長期的な成長を目指して積極的な運用を行います。
主要投資対象	わが国の中小型株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>①主として、わが国の取引所上場株式 (これに準ずるものを含みます) のうち、中小型株式に投資します。具体的には、以下の方針に基づいて銘柄選択を行います。市場動向、業界動向、技術動向など成長ポテンシャルの観点から投資対象候補の絞り込みを行い、マネジメントに対する評価なども踏まえた上で組入銘柄を決定します。</p> <p>②株式への投資比率は、原則として高位 (80%以上) を保ちます。ただし、相場下落の可能性が高いと判断した場合には、キャッシュ比率の引上げおよび以下に記載する有価証券先物取引等により、実質的な株式への投資比率を引下げるよう努めます。</p> <p>③株式以外の資産への投資は、原則として投資信託財産総額の 50%以下とします。</p> <p>④ただし、資金動向、市況動向、残存信託期間等の事情によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができるものとします。</p>
主な投資制限	<p>①株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>②新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。</p> <p>③投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。</p> <p>④同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。</p>

	<p>⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>⑥同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>⑦外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>⑧一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：6月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年9月22日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

3. 国内株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（※）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場している株式
投資態度	<p>①原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>②株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。</p> <p>③投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p>

	<p>④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。</p>
主な投資制限	<p>①株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>③新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>⑤同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>⑧前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
決算日	年1回:5月29日(休業日の場合は翌営業日)
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

- ①TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（以下、「配当込みTOPIX」という。）の指数値及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有する。
- ②JPXは、配当込みTOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、配当込みTOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又は配当込みTOPIXに係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。
- ③JPXは、配当込みTOPIXの指数値及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の配当込みTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではない。
- ④JPXは、配当込みTOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また、JPXは、配当込みTOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。
- ⑤本件商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではない。
- ⑥JPXは、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負わない。
- ⑦JPXは、当社又は本件商品の購入者のニーズを配当込みTOPIXの指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではない。
- ⑧以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しない。

4. 日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所等に上場している株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>①主としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）（※）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>②株式への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>③株式以外の資産への投資割合は、原則として投資信託財産総額の 50%以下とします。</p> <p>④資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。</p> <p>③外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをい</p>

	い、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。) について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数 (配当込み)
決算日	年 1 回：4 月 5 日 (休業日の場合は翌営業日)
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021 年 4 月 23 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数」は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、親指数 (MSCI ジャパン IMI) 構成銘柄の中から、親指数における各 GICS 業種分類の時価総額 50% を目標に、ESG 評価に優れた企業を選別して構築される指数です。この選別手法により、ESG 評価の高い企業を選ぶことで発生しがちな業種の偏りが抑制されています。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

当ファンドは、MSCI Inc. (以下「MSCI」)、その関連会社、情報提供会社又は MSCI 指数の編集又は計算に関連するその他の第三者 (総称して「MSCI 当事者」) が支援、保証、販売又は販売促進するものではありません。MSCI 指数は、MSCI が独占的に所有しています。MSCI 及び MSCI 指数の名称は、MSCI 又はその関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的のための使用について許諾されているものです。いかなる MSCI 当事者も当ファンドの発行者、受益者、あるいはその他の個人もしくは法人に対して、ファンドの全般的又は当ファンドの特定の投資の妥当性、もしくは MSCI 指数の株式市場のパフォーマンスに追従する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明又は保証を行いません。MSCI 又はその関連会社は特定の商標、サービスマーク、商号の所有者であり、当ファンドの発行者、受益者あるいはその他の個人もしくは法人とは無関係で、MSCI が決定、構成、計算する MSCI 指数の所有者です。いかなる MSCI 当事者も、MSCI 指数について決定、構成又は計算するにあたり、当ファンドの発行者又は受益者、あるいはその他の個人もしくは法人の要求を考慮する義務を一切負いません。いかなる MSCI 当事者も、当ファンドの設定時期、価格、数量に関する決定又は償還価格及び数式の決定及び算定に参加しておらず、且つその責任を負うものではありません。さらに、いかなる MSCI 当事者も当ファンドの運営・管理、マーケティング又は募集に関連して、発行者、受益者、その他の個人もしくは法人に対して一切の義務又は責任を負いません。MSCI は、MSCI が信頼できると考える情報源から MSCI 指数の算出に使用するための情報を入手するものとしますが、いずれの MSCI 当事者も、いかなる MSCI 指数又はそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI 当事者は、明示的、暗示的を問わず発行者、受益者、その他の個人もしくは法人がいかなる MSCI 指数又はそのデータを使用して得られる結果に関して、いかなる保証もしません。MSCI 当事者は、MSCI 指数もしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。さらに、MSCI 当事者は、いかなる種類の明示的、黙示的な保証をするものではなく、MSCI 指数もしくはそのデータに関して、商品性及び特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなる場合も MSCI 当事者は、直接的、間接的、特別的、懲罰的、派生的損害、及びその他の損害 (逸失利益を含む) について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。当ファンドの購入者、販売者、受益者、又はその他の個人もしくは法人も、MSCI の許諾が必要かどうかを判断するために最初に MSCI に問い合わせることなく、当ファンドを支援・保証、販売又は販売促進するために MSCI の商号、商標又はサービスマークを使用又は言及することはできません。いかなる状況においても、MSCI の事前の書面による許諾なしに、いかなる個人も法人も MSCI との関係性を主張することはできません。

5. 国内株式アクティブバリュースタート（適格機関投資家専用）

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数）（※））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行いません。
主要投資対象	アクティブバリュースタート（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	主として、マザーファンド受益証券に投資を行ない、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行いません。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。 ②投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行ないません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。 ⑤デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとし、
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）
決算日	年1回：10月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	①分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。 ③留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行いません。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.517%（税抜 0.47%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年9月28日
信託期間	2018年9月28日から2028年10月25日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社J P X総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

6. 日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社
運用の基本方針	信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主要投資対象	日本長期成長株集中投資マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>①主としてマザーファンドの受益証券に投資し、原則として、その組入れ比率は高位に保ちます（ただし、投資環境等により、当該受益証券の組入れ比率を引き下げる場合もあります。）。</p> <p>②信託財産は、マザーファンドを通じて主として日本の上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資します。マザーファンドにおいては、個別企業の分析を重視したボトム・アップ手法による銘柄選択を行い、原則として大型株式および中小型株式の中から持続的な成長が期待できると判断する比較的少数の銘柄でポートフォリオを構築し、長期的な投資元本の成長を追求します。</p> <p>③事業の収益性、経営陣の質に加えて株価評価基準の総合評価、目標株価からの乖離、流動性等を勘案して、銘柄選択を行います。</p> <p>④投資状況に応じ、マザーファンドと同様の運用を直接行うこともあります。</p> <p>⑤ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント（シンガポール）ピーティーイー・リミテッドに日本株式の運用（デリバティブ取引等に係る運用を含みます。）の指図に関する権限を委託します。</p> <p>⑥市況動向や資金動向その他の要因等によっては、運用方針に従った運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>②デリバティブ取引（法人税法第 61 条の 5 に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>③新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の 20%以下とします。</p> <p>④同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の 5%以下とします。</p> <p>⑤投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。</p>

	<p>⑥外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 30%以下とします。</p> <p>⑦株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の 50%以下とします。</p> <p>⑧デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会規則に従い、委託者が定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>⑨一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以下とし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年 2 回：6 月および 12 月の 15 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎計算期末に原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。</p> <p>①分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当等収益および売買損益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。</p> <p>②分配金額は、基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、基準価額水準、市場動向等によっては分配を行わないこともあります。また、基準価額が当初元本を下回る場合においても分配を行うことがあります。</p> <p>③収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、特に制限を設けず、元本部分と同様に運用の基本方針に基づき運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率 0.7095%（税抜 0.645%）
信託財産留保額	解約申込受付日の基準価額に 0.1%の率を乗じて得た額
設定日	2014 年 6 月 10 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	みずほ信託銀行株式会社

7. FOFs 用国内株式 EVI バリューフンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友 DS アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「日本株 EVI ハイアルファマザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>①マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に以下のような運用を行い、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（※）をベンチマークとして、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。</p> <ul style="list-style-type: none"> 日本の株式を主要投資対象とします。 運用に当たっては、独自算出に基づく企業価値や各種バリュースタイル指標（PBR、PER、配当利回り）等による割安と判断される銘柄の中から、ファンダメンタル分析により投資魅力のある銘柄に厳選投資します。 <p>②マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。</p>

	<p>③株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>④資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への投資は行いません。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年1回：6月6日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	収益分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託者が決定します。ただし、委託者の判断により分配を行わないことがあります。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.495%（税抜 0.45%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年3月17日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社J P X総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）に帰属します。J P Xは、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXにかかる標章または商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。また、J P Xは当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

8. 外国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）（※）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	原則として、MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）を構成している国の株式
投資態度	<p>①原則としてMSCI コクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>②株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。</p> <p>③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>⑤有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市</p>

	<p>場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>⑥ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>⑦投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>⑧投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。</p>
主な投資制限	<p>①株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>④同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>⑤同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCI コクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「MSCI コクサイ・インデックス」とは、MSCI Inc. が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを

表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。MSCI コクサイ・インデックスに関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利は MSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は MSCI コクサイ・インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

9. 外国株式 ESG リーダーズインデックスマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式（預託証券（DR）を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
投資態度	①主としてわが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、MSCI コクサイ ESG リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）（※）に連動する投資成果を目指します。 ②株式への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 ④資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	MSCI コクサイ ESG リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）
決算日	年 1 回：6 月 25 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021 年 7 月 8 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「MSCI コクサイ ESG リーダーズ指数」は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界主要国の株式の

中から、相対的にESG評価の高い銘柄を選定することで構築される指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。

当ファンドは、MSCI Inc. (以下「MSCI」)、その関連会社、情報提供会社又はMSCI 指数の編集又は計算に関連するその他の第三者(総称して「MSCI 当事者」) が支援、保証、販売又は販売促進するものではありません。MSCI 指数は、MSCI が独占的に所有しています。

MSCI 及びMSCI 指数の名称は、MSCI 又はその関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的のための使用について許諾されているものです。

いかなるMSCI 当事者も当ファンドの発行者、受益者、あるいはその他の個人もしくは法人に対して、ファンドの全般的又は当ファンドの特定の投資の妥当性、もしくはMSCI 指数の株式市場のパフォーマンスに追従する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明又は保証を行いません。MSCI 又はその関連会社は特定の商標、サービスマーク、商号の所有者であり、当ファンドの発行者、受益者あるいはその他の個人もしくは法人とは無関係で、MSCI が決定、構成、計算するMSCI 指数の所有者です。いかなるMSCI 当事者も、MSCI 指数について決定、構成又は計算するにあたり、当ファンドの発行者又は受益者、あるいはその他の個人もしくは法人の要求を考慮する義務を一切負いません。いかなるMSCI 当事者も、当ファンドの設定時期、価格、数量に関する決定又は償還価格及び数式の決定及び算定に参加しておらず、且つその責任を負うものではありません。さらに、いかなるMSCI 当事者も当ファンドの運営・管理、マーケティング又は募集に関連して、発行者、受益者、その他の個人もしくは法人に対して一切の義務又は責任を負いません。MSCI は、MSCI が信頼できると考える情報源からMSCI 指数の算出に使用するための情報を入手するものとしませんが、いずれのMSCI 当事者も、いかなるMSCI 指数又はそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI 当事者は、明示的、暗示的を問わず発行者、受益者、その他の個人もしくは法人がいかなるMSCI 指数又はそのデータを使用して得られる結果に関して、いかなる保証もしません。MSCI 当事者は、MSCI 指数もしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。さらに、MSCI 当事者は、いかなる種類の明示的、黙示的な保証をするものではなく、MSCI 指数もしくはそのデータに関して、商品性及び特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなる場合もMSCI 当事者は、直接的、間接的、特別的、懲罰的、派生的損害、及びその他の損害(逸失利益を含む)について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、受益者、又はその他の個人もしくは法人も、MSCI の許諾が必要かどうかを判断するために最初にMSCI に問い合わせることなく、当ファンドを支援・保証、販売又は販売促進するためにMSCI の商号、商標又はサービスマークを使用又は言及することはできません。いかなる状況においても、MSCI の事前の書面による許諾なしに、いかなる個人も法人もMSCI との関係を主張することはできません。

10. 新興国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)(※)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)
投資態度	①主として、取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還

	<p>価格が概ね連動する債券を活用することがあります。</p> <p>②株式（DR（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。</p> <p>③組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>④投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> <p>⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>③投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2008年12月12日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「MSCI エマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc. が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。MSCI エマージング・マーケット・インデックスに関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利は

MSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は MSCI エマージング・マーケット・インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

11. グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント株式会社
運用の基本方針	投資信託財産の長期的な成長を図ることを目的として運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	グローバル・フランチャイズ・マザーファンドⅢ（以下、「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	①マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の株式に投資を行い、投資信託財産の長期的な成長を目指します。 ②有力な無形資産（特許、著作権、ブランド等）を有し、中長期的に株主価値の高い成長をもたらすことが期待される企業を厳選して投資を行います。 ③実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ④資金状況、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合もあります。
主な投資制限	①株式の実質投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産の実質投資割合には制限を設けません。 ③新株引受権証券並びに新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 20%以下とします。 ④同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。 ⑤同一銘柄の新株引受権証券並びに新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ⑥同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。 ⑦デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。 ⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ 100 分の 10、合計で 100 分の 20 を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑨デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年 1 回：4 月 15 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②分配金額は、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合には委託者の判断で分配を行わな

	いことがあります。 ③収益の分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.814%（税抜0.74%） マザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を受けた者が受ける報酬は、委託者との間で別に定める取決めに基づく金額を、委託者から支払うものとしします。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年3月25日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

12. ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	フランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主に「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券に投資することにより、信託財産の長期的な成長を目指します。
主要投資対象	「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。 ＜マザーファンドの投資対象＞ 日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券を主要投資対象とします。
投資態度	①「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長を目指します。 ②MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、円換算ベース）（※）をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。ただし、この目標の達成を約束するものではありません。 ③「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ④資金動向や市場動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ＜マザーファンドの投資態度＞ ①主として、日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券に投資を行います。 ②MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、円換算ベース）をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。ただし、この目標の達成を約束するものではありません。 ③マクロ分析に基づくトップダウンの投資判断と、ボトムアップの個別銘柄分析に基づく銘柄選択を合わせて、本源的価値に比べて割安と判断される銘柄を厳選し、ポートフォリオを構築します。

	<p>④原則として対円での為替ヘッジを行いません。ただし、見通しに基づいて米ドルを基準として相対的な魅力度を判断して、外国為替の予約取引等を通じて個別株式選択の結果とは異なる通貨配分とする場合があります。</p> <p>⑤資金動向や市場動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>⑥運用の指図に関する権限を投資顧問会社であるブランディワイン・グローバル・インベストメント・マネジメント・エルエルシーに委託します。</p>
主な投資制限	<p>①株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>②新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。</p> <p>③同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>④同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>⑤同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>⑥投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>⑦外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>⑧為替予約の利用及びデリバティブの使用は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>⑨一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(税引き後配当込み、円換算ベース)
決算日	年1回：9月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>原則、毎決算時に分配を行います。</p> <p>分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合は、分配を行わない場合があります。</p> <p>※分配金は、決算日から起算して5営業日以内に支払われます。</p>
信託報酬	<p>純資産総額に対し、年率0.671%（税抜0.61%）</p> <p>このほか、信託事務の諸費用及びその他諸費用（監査費用、印刷等費用、計理及びこれに付随する業務の委託等の費用、受益権の管理費用等。純資産総額の0.05%を上限）をファンドから支弁します。</p>
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年9月24日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を含む世界の主要先進国・新興国の株式で構成されています。MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、円換算ベース）は、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、ドルベース）をもとに、委託者が独自に円換算したものです。MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権は、全て MSCI Inc. に帰属します。MSCI Inc. では、かかるデータに基づく投資による損失に一切責任を負いません。

13. ニッセイ／サンダース・グローバルバリュース株式ファンド（FOF s 用）（適格機関投資家専用）

運用会社	ニッセイアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。
主要投資対象	ニッセイ／サンダース・グローバルバリュース株式 マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、直接株式等に投資を行う場合があります。 <マザーファンドの投資対象> 日本を除く世界各国の株式等を主要投資対象とします。
投資態度	①主として、ニッセイ／サンダース・グローバルバリュース株式 マザーファンドへの投資を通じて、実質的に日本を除く世界各国の株式等に投資することにより、信託財産の中長期的な成長をめざします。 ②上記マザーファンドの受益証券の組入比率は、原則として高位に保ちます。 ③MSCI KOKUSAI Index（円換算ベース・配当込・税引後）をベンチマークとします。 ④実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ⑤資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。 <マザーファンドの投資態度> ①主として日本を除く世界各国の企業が発行する株式等を中心に投資を行います。 ②徹底的なりサーチと行動ファイナンスのアプローチに基づき、市場の懸念によりファンダメンタルズよりも割安に評価されている銘柄を選定します。 ③運用にあたっては、Sanders Capital, LLC に運用指図に関する権限（国内の短期金融資産の指図に関する権限を除きます。）を委託します。 ④MSCI KOKUSAI Index（円換算ベース・配当込・税引後）をベンチマークとします。 ⑤外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ⑥資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ②同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以下とします。 ③新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 20%以下とします。 ④同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以下とします。

	<p>⑤同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>⑥投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>⑦外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>⑧デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）及び外国為替予約取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的並びに価格変動リスク、金利変動リスク及び為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>⑨デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>⑩一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	MSCI KOKUSAI Index（円換算ベース・配当込・税引後）
決算日	年1回：3月5日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<ul style="list-style-type: none"> ・分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ・分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ・留保益（収益分配にあてず信託財産に留保した収益）については、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.7381%（税抜0.671%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年3月7日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「MSCI KOKUSAI Index（配当込・税引後）」は、MSCI Inc. が公表している指数であり、日本を除く主要先進国の株式により構成されています。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。なお、「円換算ベース」とは同指数をもとに、委託者が独自に円換算したものです。

14. 世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。

主要投資対象	<p>世界エクイティ・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。</p> <p><マザーファンドの投資対象></p> <p>日本を含む世界の金融商品取引所上場株式（預託証券を含みます。以下同じ。）</p>
投資態度	<p>①主として、世界エクイティ・マザーファンド受益証券に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。</p> <p>②マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。</p> <p>③ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、並びに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p><マザーファンドの投資態度></p> <p>①主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場されている株式に分散投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。</p> <p>②株式の銘柄選定にあたっては、市場動向や銘柄毎の成長性、収益性、流動性等を勘案して行ないます。</p> <p>③株式の組入比率は、高位を維持することを基本とします。</p> <p>④外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。</p> <p>⑤ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、並びに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>⑥運用指図権限を日興アセットマネジメント ヨーロッパ リミテッドに委託します。</p>
主な投資制限	<p>①株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>②投資信託証券（マザーファンド及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>③外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>原則として以下の通り収益分配を行います。</p> <p>①分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益及び売買益（評価益を含む）等の全額とします。</p> <p>②分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。</p> <p>③留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。</p>
信託報酬	<p>純資産総額に応じて以下の率を乗じて得た額とします。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・純資産総額 100 億円以下の部分 年率 0.704%（税抜 0.64%） ・純資産総額 100 億円超、200 億円以下の部分 年率 0.649%（税抜 0.59%） ・純資産総額 200 億円超の部分 年率 0.594%（税抜 0.54%） <p>このほか、有価証券の貸付の指図を行なった場合には、その品貸料（マザー</p>

	ファンド（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として、收受する規定のあるものに限ります。）における品貸料は、この投資信託の時価総額に応じて按分する。）に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年12月16日
信託期間	2022年12月16日から2038年5月20日まで
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

15. Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL

投資顧問会社	キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー
運用の基本方針	投資信託財産の長期的な成長を目指します。
主要投資対象	世界各国の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>①主として世界各国の金融商品取引所（これに準ずるものを含みます。）に上場され、またはその他の規制ある市場で取引されている株式に投資を行い、投資信託財産の長期的な成長を目標とします。</p> <p>②投資にあたっては、サステナビリティ・リスクを勘案し、温室効果ガス排出量及び環境・社会・ガバナンス（ESG）や社会的規範を考慮した運用を行います。</p> <p>③市場動向によっては、非上場株式及び債券等に投資を行う場合があります。</p> <p>④市況動向、資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①原則として同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>②原則として同一銘柄の転換社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>③原則として同一銘柄の新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>④純資産総額の10%を超えての借入れは、行いません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年12月31日
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	<p>年率0.525%</p> <p>その他の費用</p> <p>ファンド管理費用：上限年率0.15%</p> <p>その他、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料及びデリバティブ取引に要する費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。</p>
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年11月7日
信託期間	無期限
関係法人	<p>・管理会社</p> <p>キャピタル・インターナショナル・マネジメント・カンパニー・エス・エ</p>

	イ・アール・エル ・投資顧問会社 キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー ・管理事務代行会社 J.P. モルガン・エス・イー（ルクセンブルク支店） ・名義書換事務受託会社 J.P. モルガン・エス・イー（ルクセンブルク支店） ・保管受託銀行 J.P. モルガン・エス・イー（ルクセンブルク支店）
--	---

16. J-REIT インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証 REIT 指数（配当込み）（※）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券
投資態度	<p>①わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証 REIT 指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>②不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。</p> <p>③投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに東証 REIT 指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。ただし、東証 REIT 指数（配当込み）における時価の構成割合が 10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証 REIT 指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証券、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。</p> <p>④外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>⑤投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するた</p>

	<p>め、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。</p> <p>⑥一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>⑦デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	東証 REIT 指数（配当込み）
決算日	年 1 回：11 月 10 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008 年 1 月 9 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「東証 REIT 指数」とは、株式会社 J P X 総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場している REIT（不動産投資信託証券）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

- ①同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利は J P X が有しています。
- ② J P X は、同指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は同指数に係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。
- ③ J P X は、同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④ J P X は、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、J P X は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
- ⑤本件商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではありません。
- ⑥ J P X は、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ⑦ J P X は、当社又は本件商品の購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではありません。
- ⑧以上の項目に限らず、J P X は本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

17. グローバル REIT インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P 先進国 REIT 指数（除く日本、配当込み、円ベース）（※）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券
投資態度	①日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P 先進国 REIT 指数（除く日本、配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。 ③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 ④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができません場合があります。
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。ただし、S&P 先進国 REIT 指数（除く日本、配当込み、円ベース）における時価の構成割合が 10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に S&P 先進国 REIT 指数（除く日本、配当込み、円ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。 ③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。 ④外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ⑤一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	S&P 先進国 REIT 指数（除く日本、配当込み、円ベース）
決算日	年 1 回：11 月 10 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008 年 1 月 9 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「S&P 先進国 REIT 指数」とは、S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が公表する指数で、世界主要

国に上場する REIT（不動産投資信託証券）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

S&P 先進国 REIT 指数（以下「当インデックス」）は、S&P Global の一部門である S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's^(R) 及び S&P^(R) は、S&P Global の一部門である Standard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones^(R) は Dow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスが SPDJI に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P 又はそれぞれの関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indices は、当ファンドの所有者又はいかなる一般人に対して、株式全般又は具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追従する S&P 先進国 REIT 指数の能力に関して、明示又は黙示を問わず、いかなる表明又は保証もしません。S&P 先進国 REIT 指数に関して、S&P Dow Jones Indices と当社との間にある唯一の関係は、当インデックスと S&P Dow Jones Indices 又はそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、及び商標名のライセンス供与です。S&P 先進国 REIT 指数は当社又は当ファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indices によって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indices は、S&P 先進国 REIT 指数の決定、構成又は計算において当社又は当ファンドの所有者の要求を考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indices は、当ファンドの価格又は数量、あるいは当ファンドの新規設定又は販売のタイミングの決定、当ファンドが将来換金、譲渡、又は償還される計算式の決定又は計算に関して責任を負わず、またこれに関与したことはありません。S&P Dow Jones Indices は、当ファンドの管理、マーケティング、又は取引に関して、いかなる義務又は責任も負いません。S&P 先進国 REIT 指数に基づく投資商品が、インデックスのパフォーマンスを正確に追従する、あるいはプラスの投資収益を提供する保証はありません。SPDJI は投資顧問会社ではありません。インデックスに証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indices がかかる証券の売り、買い、又はホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

S&P Dow Jones Indices は、当インデックス又はその関連データ、あるいは口頭又は書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、又は完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indices は、これに含まれる誤り、欠落又は中断に対して、いかなる義務又は責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indices は、明示的又は黙示的を問わず、いかなる保証もせず、当インデックス又はそれに関連するデータの商品性、特定の目的又は使用への適合性、それらを使用することによって当社、当ファンドの所有者、又はその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indices は、利益の逸失、営業損失、時間又は信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、又は派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、又は厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indices のライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indices と当社との間の契約又は取り決めの第三者受益者は存在しません。

18. ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	別に定める金現物に投資する上場投資信託証券（以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。 <別に定める金現物に投資する上場投資信託証券> (2023年9月29日現在) iShares Gold Trust

	SPDR Gold Shares
投資態度	<p>①主として投資対象上場投資信託証券に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）（以下「ベンチマーク」といいます。）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>②投資対象上場投資信託証券は、この投資信託の商品性及び運用上の効率性等を損なわない範囲で、委託者の判断により見直しを行うことがあります。</p> <p>③投資対象上場投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、デリバティブ取引等を活用することがあります。このため、有価証券の組入総額とデリバティブ取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>⑤資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	<p>LBMA 金価格（円ヘッジベース）（※）（2023年9月29日現在）</p> <p>ただし、この投資信託が主要投資対象とする投資対象上場投資信託証券が参照するベンチマークが変更された場合、上記のベンチマークも変更となる場合があります。</p>
決算日	年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2017年10月11日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※LBMA 金価格の正式名称は LBMA Gold Price PM といい、ICE ベンチマーク・アドミニストレーション・リミ

テッド (ICE Benchmark Administration Limited) によってロンドン時間の午後に公表される 1 トロイオンスあたりの金現物価格 (米ドル建て) を指します。なお、LBMA は、ロンドン貴金属市場協会 (London Bullion Market Association) の略称です。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して当社が独自に算出した指数です。

ICE ベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド (ICE Benchmark Administration Limited) は、LBMA 金価格及び LBMA 金価格が示す、あらゆる特定の日、特定の時点における数値により生じた結果について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

ICE ベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、当ファンドに関する商品性や特定目的への適合性について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

19. BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund – クラス S-JPY

管理会社	BlueBay Funds Management Company S. A.
運用の基本方針	主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。
主要投資対象	わが国を含む世界の投資適格債券を主要投資対象とし、デリバティブ取引及び為替予約取引を主要取引対象とします。 なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。
投資態度	①主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。 ②ポートフォリオの構築は、買建 (ロングポジション) だけでなく売建 (ショートポジション) でも行います。また、債券投資の代替手段としてデリバティブ取引を活用することがあります。 ③債券の組入総額とデリバティブ取引の想定元本の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行うことがあります。 ⑤資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①投資適格債券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 50%以上とします。 ②投資信託証券 (上場投資信託を除きます。) への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年 6 月 30 日 (休業日の場合は前営業日)
収益の分配	収益の分配は行いません。
信託報酬	年率 0.74% なお、この報酬率には投資顧問会社の運用報酬の他、管理会社・管理事務代行会社・名義書換事務受託会社・保管受託銀行の報酬が含まれています。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2011 年 5 月 24 日
関係法人	・管理会社 BlueBay Funds Management Company S. A. ・投資顧問会社 RBC Global Asset Management (UK) Limited

	<ul style="list-style-type: none"> ・副投資顧問会社 RBC Global Asset Management (U.S.) Inc. ・管理事務代行会社／名義書換事務受託会社／保管受託銀行 Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.
--	---

20. ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、ゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社の発行する円建債券（当マザーファンドの説明において、以下「円建債券」といいます。）を主要投資対象とし、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	円建債券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>①主として円建債券への投資を通じて、ピクテグループの運用会社が運用する外国投資信託証券「Pictet TR - Diversified Alpha」（以下「Pictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンド」※といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>※Pictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンドは、世界の株式、債券、為替等の多様な資産に対して、様々な投資手法を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うルクセンブルク籍投資信託証券です。</p> <p>②円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>③資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、こととし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>③外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えるこ</p>

	ととなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：8月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2015年12月11日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

21. FOF s用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	MAN AHL ダイバーシファイド リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>①マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてUBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社（SPC）の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます。）に投資し、AHL Partners LLPが運用する外国投資信託証券「Man AHL Diversified (Cayman) Ltd」（以下「MAN AHL ファンド」※といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>※MAN AHL ファンドは、主として世界各国の株式、債券、金利、商品、為替等の先物取引等に投資を行い、定量分析モデルを用いて市場動向を予測し、上昇局面だけでなく下落局面でも収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券です。なお、MAN AHL ファンドは、組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行うことがあります。</p> <p>②円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>③資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、こととし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>③外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

	⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 ①分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。 ③留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.066%（税抜 0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2016年1月20日
信託期間	原則として、2016年1月20日から2025年10月10日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

22. 米国株式LSマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	UBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社（SPC）の発行する米ドル建債券（以下「米ドル建債券」といいます。）を主要投資対象とします。
投資態度	①米ドル建債券への投資を通じて、主として米国の金融商品取引所等に上場している株式等の買建（ロングポジション）と売建（ショートポジション）を組み合わせたマーケット・ニュートラル戦略による運用※を行います。 ※米ドル建債券への投資額のうち、マーケット・ニュートラル戦略による運用に用いられない余剰資金は、原則として米ドル建MMFもしくはそれに類するもの又は米ドル建公社債、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券もしくは短期金融商品等により運用されます。 ②米ドル建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。 ④資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポジ

	<p>ャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2017年10月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

23. コモディティ LS アルファ・マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	<p>主としてブルームバーグ商品指数（※）の騰落率とブルームバーグ商品フォワード指数（以下、「フォワード指数」※1といいます。）の騰落率の差に基づいて償還価格が決定される円建債券※2（以下、「円建債券」といいます。）を主要投資対象とします。</p> <p>※1 この投資信託においてフォワード指数とは、ブルームバーグ商品指数と構成商品（エネルギー、穀物、非鉄、貴金属等に係る各種商品先物）及び構成比率を同一としながら、異なる限月の商品先物で構成された指数をいいます。</p> <p>※2 運用効率の向上を目的として、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に一定数を乗じた数値とフォワード指数の騰落率に一定数を乗じた数値の差に基づいて償還価格が決定される円建の債券に投資することがあります。なお、この場合、夫々の指数騰落率に乘じる一定数は同値とします。</p>
投資態度	<p>①円建債券への投資を通じて、ブルームバーグ商品指数とフォワード指数の間でロング・ショート戦略に基づく運用を行い、絶対収益の獲得を目指します。</p> <p>②円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>③資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないこ

	<p>とをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限り、行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>③外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年7月8日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※ブルームバーグ商品指数は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）及び、その関係会社とUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。

ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity IndexSM）及び「ブルームバーグ（Bloomberg[®]）」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）及び、その関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）のサービスマークであり、当社による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity IndexSM）は、ブルームバーグとUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー及びその関係会社（以下「UBS」と総称します。）のいずれも、当社の関係会社ではなく、ブルームバーグ及びUBSは、当ファンドを承認し、是認し、レビューし又は推奨するものではありません。ブルームバーグ及びUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity IndexSM）に関連するいかなるデータ又は情報の適時性、正確性又は完全性も保証するものではありません。

24. GBCAマザーファンド（ミドルリスク型）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本の円建短期公社債等を主要投資対象とし、先進国の債券先物取引及び世界主要通貨の為替予約取引を主要取引対象とします。
投資態度	<p>①主として日本の円建短期公社債等に投資するとともに、先進国の債券先物取引及び世界主要通貨の為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。</p> <p>②債券先物取引及び為替予約取引等は、原則として定量的手法に基づいた複数の運用戦略を組み合わせることで行います。</p> <p>③資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>④デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>⑤為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>⑥一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>⑦デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：2月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年3月25日

信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

25. ノムラ FOFs 用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	野村アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	日本成長株投資マザーファンド受益証券および野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、TOPIX（東証株価指数）を対象とした株価指数先物取引（以下、「株価指数先物取引」といいます。）を主要取引対象とします。なお、株式等に直接投資する場合があります。
投資態度	<p>各マザーファンド受益証券を主要投資対象、株価指数先物取引を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。</p> <p>①各マザーファンド受益証券に投資を行うとともに、株価指数先物取引を活用します。株価指数先物取引の活用にあたっては、実質的に投資する株式に対する株式市場全体の変動の影響を抑えることを目指し、株価指数先物取引の売建てを行います。各マザーファンド受益証券への投資割合および株価指数先物取引の売建ての枚数は、市場環境や各マザーファンドの特性等を考慮し、適宜調整を行うことを基本とします。</p> <p>②各マザーファンド受益証券の合計組入比率は、原則として信託財産の純資産総額の 70%～90%程度を維持することを基本とします。ただし、株価指数先物取引を行うにあたって必要となる証拠金の額等によっては、上記の範囲と異なる場合があります。</p> <p>③非株式割合（株式以外の資産への実質投資割合）は、原則として信託財産総額の 50%以下とすることを基本とします。</p> <p>④資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p><日本成長株投資マザーファンドの投資態度></p> <p>①わが国の株式の中から、個別企業の調査・分析等に基づいたボトムアップアプローチにより、企業の経営戦略や財務戦略などを通じて長期的な株主資本成長や利益成長が期待できる銘柄を選定します。</p> <p>②ポートフォリオの構築にあたっては、株主資本や利益等の成長率の高さ及びその継続性等に関する評価に基づき組入銘柄を決定し、バリュエーション評価（株価の割高・割安の度合い）等を勘案して組入比率を決定します。</p> <p>③株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。</p> <p>④非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の 50%以下とすることを基本とします。</p> <p>⑤資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p><野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンドの投資態度></p> <p>①株式への投資にあたっては、財務リスク・流動性等を考慮し、投資候補銘柄を選定した上で定量モデルにより最適化を行い、ポートフォリオのボラティリティを最小化することを目指します。</p> <p>②ポートフォリオの最適化にあたっては、業種配分、投資銘柄数、個別銘柄へ</p>

	<p>の投資比率、取引コスト等を勘案します。</p> <p>③株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の 50%以下とすることを基本とします。</p> <p>④資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以下とします。</p> <p>③同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以内とします。</p> <p>④デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>⑤新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 20%以内とします。</p> <p>⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以内とします。</p> <p>⑦同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以内とします。</p> <p>⑧投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以内とします。</p> <p>⑨一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行いません。</p> <p>⑩一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年 1 回：12 月 20 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	純資産総額に対し、年率 0.506%（税抜 0.46%）
信託財産留保額	解約申込受付日の基準価額に 0.3%の率を乗じて得た額
設定日	2019 年 4 月 10 日
信託期間	無期限
受託会社	野村信託銀行株式会社

26. ウェスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）

運用会社	フランクリン・templton・ジャパン株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主に「ウェスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主に日本の公社債に投資を行うとともに、為替予約取引等を積極的に活用する通貨ロング・ショート戦略により、市場動向に左右されにくい安定した収益の獲得を目指します。
主要投資対象	「ウェスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド」受益証券を主要投

	<p>資対象とします。</p> <p><マザーファンドの投資対象> 主に日本の公社債を主要投資対象とし、為替予約取引等を積極的に活用します。</p>
投資態度	<p>①ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指します。</p> <p>②ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。</p> <p>③資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p><マザーファンドの投資態度></p> <p>①主に、日本の公社債に投資するとともに、主要先進国通貨を中心とした為替予約取引等を積極的に活用する通貨ロング・ショート戦略により、市場動向に左右されにくい安定した収益の獲得を目指します。</p> <p>②モデルによる定量分析とポートフォリオマネージャーによる定性分析を組み合わせた独自のアプローチにより、ポートフォリオを構築します。</p> <p>③リスク管理を運用プロセスに組み込み、ポジション・リスクの分散化を図ります。</p> <p>④資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>⑤運用の指図に関する権限を投資顧問会社であるウエスタン・アセット・マネジメント株式会社及びウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド（在英国）に委託します。</p>
主な投資制限	<p>①株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>②新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>③同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>④投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>⑤外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>⑥為替予約の利用及びデリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>⑦一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：11月16日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	<p>純資産総額に対し、年率0.418%（税抜 0.38%）</p> <p>このほか、信託事務の諸費用及びその他諸費用（監査費用、印刷等費用、計理及びこれに付随する業務の委託等の費用、受益権の管理費用等。純資産総額の0.05%を上限）をファンドから支弁します。</p>

	投資顧問会社の報酬は、委託者が収受する委託者報酬から支弁されます。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年4月12日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

27. MA Hedge Fund Strategies Limited

運用会社	UBS O' Connor LLC
運用の基本方針	主として、公表された合併や買収案件等において、合併案件の公表買収価格と買収先企業または買収元企業の案件成立前の株価の差異を捉える等、収益を積み上げることを目指して運用を行います。
主要投資対象	主として世界各国（日本を含みます。）の企業の株式に投資を行います。なお、関連する上場デリバティブ商品等に投資を行うことがあります。
投資態度	<p>①公表された合併・買収案件等において、買収先企業の株式を買い付け、又は買収先企業の株式を買い付けると同時に買収元企業の株式を売り建てることを基本戦略とします。なお、関連する上場デリバティブ商品等を活用することがあります。</p> <p>②ポートフォリオ構築プロセスに沿って適切な格付を付与、これに基づき確信度、リスク/リターン、ファンダメンタル要因などの分析結果に基づきポジションを決定します。</p> <p>③為替変動リスクを回避するために、原則として対円での為替ヘッジを行います。</p>
主な投資制限	<p>①投資法人財産を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。</p> <p>②投資法人財産の10%を超える借り入れは行いません。</p> <p>③一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。</p> <p>④流動性に欠ける資産への投資は、投資法人財産の15%以下とします。</p> <p>⑤外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>⑥一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>⑦投資信託証券への投資は行いません。</p> <p>⑧デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定しません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：12月31日（決算日が休日の場合は、前営業日となります。）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	<p>運用報酬：年率0.6%</p> <p>成功報酬：15%</p> <p>月末最終営業日時点の1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の月末最終営業日時点での純資産価格の最高値）を上回った場合、超過部分の15%。</p>

信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年10月10日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> ・運用会社 UBS O'Connor LLC ・保管銀行・管理事務代行会社 MUFG Alternative Fund Services (Ireland) Limited

28. MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR

投資顧問会社	Graham Capital Management, L.P.
運用の基本方針	オルタナティブ運用手法を活用して投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として世界各国の株式、債券、通貨、商品等の先物に投資します。
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・主として世界各国の株式、債券、通貨、商品等の先物で運用します。 ・トレーディング・アドバイザーの支援を受けて、各先物の市場の非効率性やトレンド等を収益機会として捕捉します。 ・各先物の収益機会の度合、ボラティリティ、流動性及び他先物との相関に係る評価等を鑑みて、各先物のロング・ショート戦略等によりポートフォリオを構築します。 ・先物取引に係る証拠金相当額に対しては、原則として対円での為替ヘッジを行います。 ・資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・先物での運用割合（想定元本ベース）は、投資信託財産の純資産総額の90%以上とします。 ・現物の空売りは行いません。 ・発行体の法的支配や経営権の取得を企図した有価証券の取得を行いません。 ・投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月の最終ファンド営業日
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	固定報酬：年率0.85% 成功報酬：12% 1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の決算日の純資産総額の最高値）を上回った場合、超過部分の12%
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年12月19日
信託期間	原則として無期限
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> ・管理会社（マネージャー） SG Kleinwort Hambros Corporate Services (CI) Limited ・投資顧問会社（トレーディング・アドバイザー） Graham Capital Management, L.P. ・副管理会社（サブ・マネージャー） Amundi Asset Management S.A.S

	<ul style="list-style-type: none"> ・管理事務代行会社（アドミニストレーター） Societe Generale Securities Services France S.A. ・名義書換事務受託会社（トランスファーエージェント） CACEIS Investor Services Bank S.A. ・保管受託銀行（カストディ） SG Kleinwort Hambros Trust Company (CI) Limited
--	---

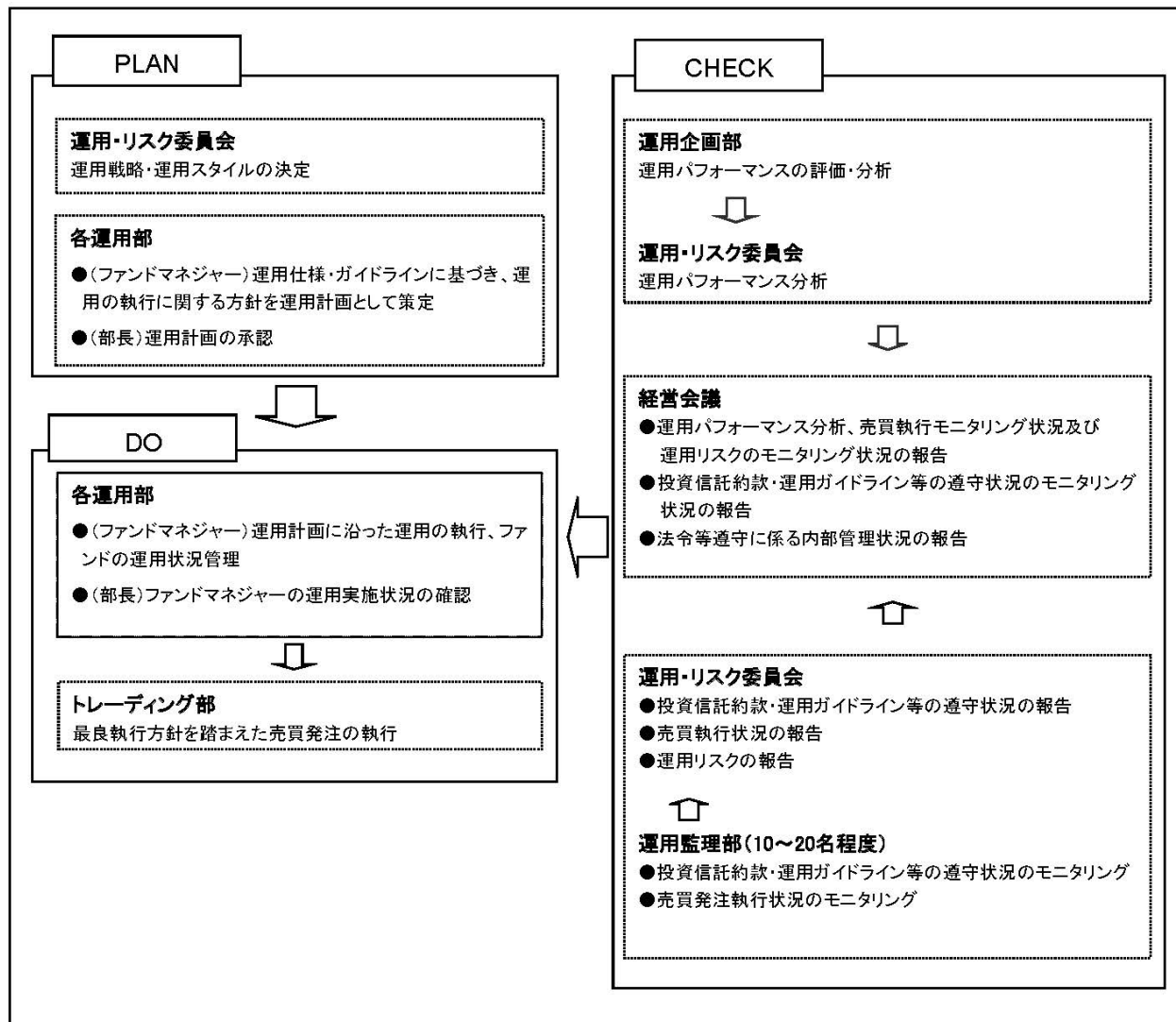
29. 米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	<p>主として米国株式イントラデイ・トレンド戦略^{※1}に基づいて償還価格が決定される円建債券（以下、「円建債券」といいます。）を主要投資対象とします。</p> <p>※1) この投資信託において米国株式イントラデイ・トレンド戦略とは、米国株式市場の1日の取引時間中の値動き^{※2}を捉えることを目的とする戦略をいいます。具体的には、一定のルールに従って株式市場が一定率以上上昇した場合には買い建てポジションを、一定率以上下落した場合には売り建てポジションを構築し、全てのポジションを当該取引日の終了時までには解消する戦略です。なお、株式市場の値動きによっては、同一日に買い建てポジションと売り建てポジションを同時に構築することや、買い建てポジションの合計額あるいは売り建てポジションの合計額が一時的に投資信託財産の純資産総額の2倍程度になることがあります。</p> <p>※2) 当該戦略の参照対象は、S&P500のほかダウ・ジョーンズ工業株価平均（NYダウ）やナスダック総合指数等の株価指数、あるいはこれらの株価指数先物も含まれます。</p>
投資態度	<p>①円建債券への投資を通じて、米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする運用を行い、収益の積み上げを目指します。</p> <p>②円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>③資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>③外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポー</p>

	<p>ジャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年 1 回：3 月 10 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020 年 10 月 6 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

(3) 【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、今後変更されることがあります。



委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行うに当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用等に係る業務規則を定めています。

委託会社は、受託会社又は再信託受託会社に対して、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、外部監査法人による内部統制の整備及び運用状況の報告書を再信託受託会社より受け取っております。

(4) 【分配方針】

- 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

(5)【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

イ. 投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ロ. 株式への投資

株式への直接投資は行いません。

ハ. 外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

ニ. デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

ホ. 公社債の借入れの指図及び範囲

(イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

(ロ) 上記(イ)の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

(ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

(ニ) 上記(イ)の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ヘ. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

ト. 外国為替予約取引の指図

委託会社は、投資信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

チ. 資金の借入れ

(イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

(ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

(ハ) 収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

リ. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

<その他の投資制限>

イ. 当ファンドでは直接デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引及び選択権付債券売買を含みます。）は行いませんが、投資対象とする投資信託でデリバティブ取引等を行う場合、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

3 【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

- 当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
- 信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。
- 投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 株価変動リスク

株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

② 金利変動リスク

債券の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。また、発行者の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

③ リートの価格変動リスク

リーの価格は、不動産市況（不動産稼働率、賃貸料、不動産価格等）、金利変動、社会情勢の変化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。また、リート及びリーの運用会社の業績、財務状況の変化等により価格が変動し、基準価額の変動要因となります。

④ 商品（コモディティ）の価格変動リスク

商品の価格は、需給関係や為替、金利変動等の様々な要因により大きく変動します。需給関係は、天候、作況、生産国（産出国）の政治、経済、社会情勢の変化等の影響を大きく受けます。商品価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

⑤ 為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。なお、投資対象ファンドにおいて、外貨建資産について、為替予約を活用し、為替変動リスクの低減を図る場合がありますが、完全にヘッジすることはできませんので、外貨の為替変動の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジを行う通貨の短期金利と円短期金利を比較して、円短期金利の方が低い場合には、当該通貨と円の金利差相当分のコストがかかりま

すが、さらに需給要因等によっては金利差相当分を上回るコストがかかる場合があることにご留意ください。

⑥信用リスク

有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

⑦流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

⑧カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。また、新興国への投資は先進国に比べ、上記のリスクが高まる可能性があります。

⑨資産等の選定・配分に係るリスク

ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資比率を変更します。この投資行動が、ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、損失が発生する要因となる場合があります。

また、投資対象とする資産やファンドの追加に伴い、新たな投資リスクが生じる可能性があります。

⑩ヘッジファンドの運用手法に係るリスク

投資対象ファンドにおいては、直接もしくは実質的に現物有価証券、デリバティブや為替予約取引等の買建てや売建てによりポートフォリオを組成することがあり、買い建てている対象が下落した場合もしくは売り建てている対象が上昇した場合に損失が発生し、ファンドの基準価額が影響を受け、投資元本を割り込むことがあります。また、投資対象ファンドの純資産総額を上回る買建て、売建てを行う場合があるため、投資対象ファンドの基準価額は現物有価証券に投資する場合と比べ大きく変動することがあり、投資元本を割り込むことがあります。

ヘッジファンドのパフォーマンスは、通常、運用者の運用能力に大きく依存することになるため、市場の動向に関わらず、損失が発生する可能性があります。

⑪仕組み債券に係るリスク

投資対象ファンドにおいては、特定の対象（指数やファンド等）の値動きに概ね連動する投資成果を目指す仕組み債券を活用する場合がありますが、投資対象ファンドが、特定の対象と連動することを保証するものではありません。

また、仕組み債券の価格は取引に関わる関係法人の財務状況等及びそれらに関する外部評価等、市場や経済環境の悪化や混乱、また概ね連動を目指すファンドの流動性の制約等により変動し、あるいは債券取引が一部不可能となる等、概ね連動を目指す対象と大きく乖離することがあります。加えて、通常、仕組み債券の取引に関わるブローカーは限定的であり（1社の場合もあります）、取引にあたっては高いコストがかかる場合があります。

なお、仕組み債券の発行体は少数であることが多いため、信用リスクが顕在化した場合には、投資対象ファンドは多数の発行体に分散投資を行う投資信託と比較して、大きな影響を被る可能性があります。また、発行体の財務状況や信用力の他、市場や経済環境の変動等により、仕組み債券が発行されない場合には、投資対象ファンドが償還となる可能性があります。

⑫ブローカーの信用リスク

投資対象ファンドにおいては、直接もしくは実質的にデリバティブや為替予約取引等を行う場合があります。

す。ブローカーの債務不履行等によって、ブローカーで保管されている証拠金の一部又は相当の額が失われる可能性や契約が履行されない可能性があり、ファンドが大きな影響を被る可能性があります。

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

- ①同じ投資対象ファンドに投資する他のファンドによる追加設定や一部解約等があり、投資対象ファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。
- ②分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりの方が小さかった場合も同様です。
- ③ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- ④ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要性が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。
これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止、取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

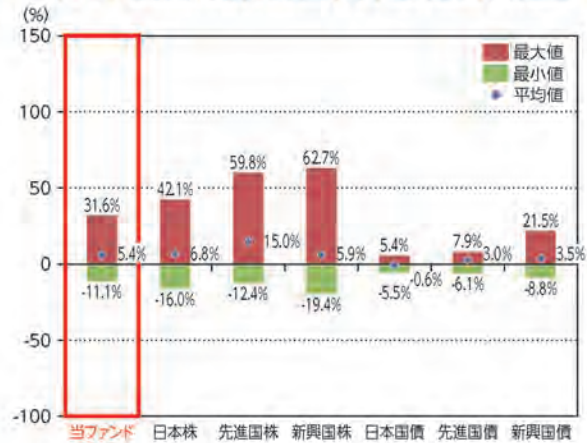
【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



- *当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- *当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- *2018年10月～2023年9月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。
- *当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数) (配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPEI(ガンガ/バント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット/グローバル・ディバーシファイド) (円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数を使用しております。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

①取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に、3.3%（税抜 3.0%）（※1）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

※1：「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます（以下同じ。）。

②「分配金再投資コース」（※2）において収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

※2：収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

③上記①及び②の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

④当ファンドが投資対象ファンドに投資する際に信託財産留保額（※3）がかかる場合、当該信託財産留保額を当ファンドが負担します。

※3：「信託財産留保額」とは、当初設定日以降の買付又は信託期間終了前の解約に際し、取得申込者又は解約者にご負担いただいて投資信託財産に繰り入れる金額のことをいいます。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(2) 【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額の控除はありません。ただし、当ファンドが保有する投資対象ファンドの解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 1.628%（税抜 1.48%）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額×信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 1.023% (税抜 0.93%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.55% (税抜 0.5%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

②信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月

終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

③信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

なお上記のほか、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

(参考) 各投資対象ファンドの信託報酬等

各投資対象ファンドの信託報酬（投資信託財産の純資産総額に対する年率）は下記の通りです。

当該信託報酬は、投資対象とする投資信託証券に係る信託財産の運用、基準価額の計算、運用財産の管理等の対価として、投資対象ファンドから支払われます。

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
FOFs用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.374%（税抜 0.34%）
中小型株式 マザーファンド	ありません。
国内株式インデックス マザーファンド	ありません。
日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	ありません。
国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.517%（税抜 0.47%）
日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.7095%（税抜 0.645%）
FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.495%（税抜 0.45%）
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	ありません。
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.814%（税抜 0.74%）
ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.671%（税抜 0.61%）
ニッセイ/サンダース・グローバルバリュー株式ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	年率 0.7381%（税抜 0.671%）
世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）	<ul style="list-style-type: none"> ・純資産総額 100 億円以下の部分 年率 0.704%（税抜 0.64%） ・純資産総額 100 億円超、200 億円以下の部分 年率 0.649%（税抜 0.59%） ・純資産総額 200 億円超の部分 年率 0.594%（税抜 0.54%）
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	年率 0.525%
J-REIT インデックス マザーファンド	ありません。
グローバルREITインデックス マザーファンド	ありません。
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。

BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund – クラス S-JPY	年率 0.74%
ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド	ありません。
FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド (適格機関投資家専用)	年率 0.066% (税抜 0.06%)
米国株式LS マザーファンド	ありません。
コモディティLS アルファ・マザーファンド	ありません。
GBCAマザーファンド (ミドルリスク型)	ありません。
ノムラ FOFs 用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド (適格機関投資家専用)	年率 0.506% (税抜 0.46%)
ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS (適格機関投資家専用)	年率 0.418% (税抜 0.38%)
MA Hedge Fund Strategies Limited	運用報酬：年率 0.6% 成功報酬：15% 月末最終営業日時点の1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク (過去の月末最終営業日時点での純資産価格の最高値) を上回った場合、超過部分の15%。
MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR	固定報酬：年率 0.85% 成功報酬：12% 1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク (過去の決算日の純資産総額の最高値) を上回った場合、超過部分の12%
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	ありません。

当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な信託報酬率の概算値は下記の通りです。ただし、この値は目安であり、投資対象ファンドの実際の組入状況等により実質的な信託報酬率は変動します。なお、投資対象ファンドによっては、別途運用実績に基づき計算される成功報酬額がかかる場合があります。

◎実質的な信託報酬率：年率 1.628%～2.18965%程度 (税抜 1.48%～2.0013%程度)
(投資対象とする投資信託証券：年率 0.0%～0.56165%程度 (税抜 0.0%～0.5213%程度))

(4) 【その他の手数料等】

- ①投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息(「諸経費」といいます。)は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します(投資対象ファンドにおいて負担する場合があります。)
- ②借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。
- ③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料(※)、組入資産の保管に要する費用(※)等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します(投資対象ファンドにおいて負担す

る場合を含みます。)

- ④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用(※)は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。
- ⑤ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用(※)は、受益者の負担とし、日々投資信託財産で負担します(投資対象ファンドにおいて負担する場合を含みます。)
- ⑥これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用は、仕組み債券の発行・管理にあたり発行者等に支払う手数料、仕組み債券の連動対象となるファンド及びファンドが組み入れるヘッジファンド等の運用者に支払う運用報酬(成功報酬を含みます。)等

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

投資助言会社が受ける報酬は、委託会社が受ける報酬の中から支払うものとし、その額は、ファンドの純資産総額に年率0.495%(税抜0.45%)を乗じて得たものとし、

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。また、上場投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託証券の費用は表示しておりません。

(ご参考)

《 仕組み債券の費用にかかる記載 》

・ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド

主要投資対象である円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.25%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
- ・円建債券の連動対象となるPictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンドにおいては、運用報酬(Pictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンドの純資産総額に対して年率1.0%)、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・FOF s用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)

実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.24%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
- ・円建債券の連動対象となるMAN AHL ファンドにおいては、固定報酬(運用報酬として1.35%(MAN AHL ファンドの純資産総額に対する年率。以下同じ。))、加えてサービスマネジャー費用として0.25%、ブローカレッジ費用として1.00%)、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・米国株式LS マザーファンド

主要投資対象である米ドル建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・米ドル建債券の評価額に対して年率0.38%が発行・管理手数料等としてかかります。加えて保管費用とし

て年率 0.02%、その他管理費用等がかかります。

- ・マーケット・ニュートラル戦略による運用額に対する運用報酬として年率 2.00%、純資産価値算出費用として年率 0.03%、有価証券の売買費用、借株費用、その他管理費用等がかかります。
- ・米ドル建MMF もしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

①個人の受益者に対する課税

イ. 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。

なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

	税 率 (内 訳)
2037 年 12 月 31 日まで	20.315% (所得税 15.315%、住民税 5%)
2038 年 1 月 1 日以降	20% (所得税 15%、住民税 5%)

(2037 年 12 月 31 日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。)

ロ. 一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ. の表の通りです。

ハ. 損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離課税を選択したものに限り）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

ニ. 少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度です。

NISA をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となりますが、2024 年 1 月 1 日以降は、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

また、2024 年 1 月 1 日以降は、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税額から控除できます。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税 率 (所得税のみ)
2037 年 12 月 31 日まで	15.315%

2038年1月1日以降

15%

(2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。)

③個別元本について

- イ. 追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- ロ. 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ハ. ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- ニ. 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について」をご参照ください。）

④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

- イ. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、
- ロ. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※上記は、2023年9月29日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

※税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

(参考情報) ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率 (1+2)	運用管理費用の比率 1	その他費用の比率 2
1.86%	1.63%	0.23%

※対象期間は2022年2月18日～2023年2月17日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、購入時手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。

※投資先ファンドについては、入手し得る情報を基に記載しています。

※投資先ファンドにかかる費用は、その他費用に含まれています。

※ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5 【運用状況】

以下は、2023年9月29日現在の状況について記載してあります。

【サテライト投資戦略ファンド（株式型）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	3,792,635,160	42.15
投資証券	ルクセンブルク	373,354,591	4.15
	ケイマン	267,066,453	2.97
	ジャージー	143,691,435	1.60
	小計	784,112,479	8.71
親投資信託受益証券	日本	4,259,996,990	47.35
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	—	160,698,165	1.79
合計（純資産総額）		8,997,442,794	100.00

（注1）国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

（注2）投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（2）【投資資産】

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	278,370,714	1.9983	556,268,198	2.3825	663,218,226	7.37
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	524,744,204	1.2197	640,040,161	1.1876	623,186,216	6.93
日本	投資信託受益証券	FOFs用国内株式EVIバリュウファンド（適格機関投資家専用）	360,143,030	1.1724	422,266,622	1.5396	554,476,208	6.16
日本	投資信託受益証券	国内株式アクティブバリュウファンド（適格機関投資家専用）	350,364,535	1.252	438,656,397	1.5687	549,616,846	6.11
日本	親投資信託受益証券	J-R E I Tインデックス マザーファンド	256,354,957	2.0373	522,284,371	2.1330	546,805,123	6.08
日本	親投資信託受益証券	グローバルR E I Tインデックス マザーファンド	176,477,358	2.5256	445,711,216	2.4838	438,334,461	4.87
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	76,157,099	4.4692	340,361,307	5.1507	392,262,369	4.36
日本	投資信託受益証券	ニッセイ／サンダース・グローバルバリュウ株式ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	269,991,633	1.3213	356,750,000	1.3984	377,556,299	4.20
ルクセンブルク	投資証券	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	201,160.879	1,641.84	330,273,977	1,856	373,354,591	4.15
日本	投資信託受益証券	グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）	192,828,866	1.7614	339,663,462	1.9254	371,272,698	4.13
日本	投資信託受益証券	ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）	285,242,148	1.2197	347,920,401	1.2993	370,615,122	4.12
日本	投資信託受益証券	世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）	321,764,066	1.1125	357,990,000	1.1512	370,414,792	4.12
日本	投資信託受益証券	日本長期成長株集中投資ファンド（適	147,870,589	2.2634	334,699,950	2.4964	369,144,138	4.10

	証券	格機関投資家専用)						
日本	親投資信託受益証券	米国株式LSマザーファンド	267,116,183	1.0681	285,306,795	1.1028	294,575,726	3.27
日本	親投資信託受益証券	コモディティLSアルファ・マザーファンド	222,383,629	1.2548	279,046,978	1.2040	267,749,889	2.98
ケイマン	投資証券	MA Hedge Fund Strategies Limited	26,508	10,040.9	266,164,360	10,074.93	267,066,453	2.97
日本	投資信託受益証券	FOFs 用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド (適格機関投資家専用)	127,323,704	1.7125	218,041,843	2.0855	265,533,584	2.95
日本	投資信託受益証券	ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド (適格機関投資家専用)	301,335,621	0.92	277,228,771	0.8703	262,252,390	2.91
日本	親投資信託受益証券	ピクテ マルチストラテジー リンクマザーファンド	218,013,770	1.0089	219,954,093	1.0285	224,227,162	2.49
日本	投資信託受益証券	ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS (適格機関投資家専用)	202,914,567	0.9301	188,750,771	0.8695	176,434,216	1.96
ジャージー	投資証券	MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR	13,095	10,376	135,873,720	10,973	143,691,435	1.60
日本	親投資信託受益証券	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	154,896,295	0.8984	139,158,831	0.8986	139,189,810	1.55
日本	親投資信託受益証券	GBCAマザーファンド (ミドルリスク型)	117,442,367	1.1494	135,000,000	1.1795	138,523,271	1.54
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	35,711,445	3.6332	129,746,822	3.8356	136,974,818	1.52
日本	親投資信託受益証券	日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	105,416,524	1.0725	113,059,222	1.2807	135,006,942	1.50
日本	親投資信託受益証券	外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	96,694,266	1.1631	112,465,101	1.3549	131,011,061	1.46
日本	親投資信託受益証券	中小型株式 マザーファンド	24,464,795	4.8583	118,857,314	5.2701	128,931,916	1.43
日本	投資信託受益証券	FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド (適格機関投資家専用)	102,653,070	1.2404	127,330,868	1.2208	125,318,867	1.39

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	42.15
投資証券	8.71
親投資信託受益証券	47.35
合計	98.21

(注) 投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

①【純資産の推移】

		純資産総額 (円)		1万口当たりの純資産額 (円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末	(2016年2月17日)	37,286,279,341	37,286,279,341	8,647	8,647
第2期計算期間末	(2017年2月17日)	30,621,118,809	30,621,118,809	9,555	9,555
第3期計算期間末	(2018年2月19日)	18,433,690,243	18,433,690,243	10,131	10,131
第4期計算期間末	(2019年2月18日)	18,337,969,638	18,337,969,638	9,864	9,864
第5期計算期間末	(2020年2月17日)	13,138,863,682	13,138,863,682	10,917	10,917
第6期計算期間末	(2021年2月17日)	11,518,211,025	11,518,211,025	11,845	11,845
第7期計算期間末	(2022年2月17日)	9,679,176,610	9,679,176,610	12,563	12,563
第8期計算期間末	(2023年2月17日)	8,916,277,272	8,916,277,272	12,791	12,791
	2022年9月末日	8,806,443,040	—	12,214	—
	10月末日	9,031,065,576	—	12,607	—
	11月末日	8,983,468,829	—	12,689	—
	12月末日	8,637,235,293	—	12,289	—
	2023年1月末日	8,850,453,532	—	12,642	—
	2月末日	8,854,073,670	—	12,727	—
	3月末日	8,796,555,240	—	12,736	—
	4月末日	8,868,933,027	—	12,924	—
	5月末日	9,012,451,637	—	13,284	—
	6月末日	9,184,302,234	—	13,777	—
	7月末日	9,148,287,381	—	13,864	—
	8月末日	9,133,634,261	—	14,015	—
	9月末日	8,997,442,794	—	13,886	—

②【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金 (円)
第1期計算期間	2015年6月16日～2016年2月17日	0
第2期計算期間	2016年2月18日～2017年2月17日	0
第3期計算期間	2017年2月18日～2018年2月19日	0
第4期計算期間	2018年2月20日～2019年2月18日	0
第5期計算期間	2019年2月19日～2020年2月17日	0
第6期計算期間	2020年2月18日～2021年2月17日	0
第7期計算期間	2021年2月18日～2022年2月17日	0
第8期計算期間	2022年2月18日～2023年2月17日	0

③【収益率の推移】

	期 間	収益率 (%)
--	-----	---------

第1期計算期間	2015年6月16日～2016年2月17日	△13.5
第2期計算期間	2016年2月18日～2017年2月17日	10.5
第3期計算期間	2017年2月18日～2018年2月19日	6.0
第4期計算期間	2018年2月20日～2019年2月18日	△2.6
第5期計算期間	2019年2月19日～2020年2月17日	10.7
第6期計算期間	2020年2月18日～2021年2月17日	8.5
第7期計算期間	2021年2月18日～2022年2月17日	6.1
第8期計算期間	2022年2月18日～2023年2月17日	1.8
第9期中間計算期間	2023年2月18日～2023年8月17日	7.7

(注1) 収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2) 小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数 (口)	解約口数 (口)	発行済み口数 (口)
第1期計算期間	2015年6月16日～2016年2月17日	49,526,375,760	6,407,778,915	43,118,596,845
第2期計算期間	2016年2月18日～2017年2月17日	11,056,157,024	22,127,791,489	32,046,962,380
第3期計算期間	2017年2月18日～2018年2月19日	8,740,142,510	22,591,145,594	18,195,959,296
第4期計算期間	2018年2月20日～2019年2月18日	7,015,265,506	6,619,741,116	18,591,483,686
第5期計算期間	2019年2月19日～2020年2月17日	1,220,521,390	7,776,843,668	12,035,161,408
第6期計算期間	2020年2月18日～2021年2月17日	167,978,519	2,478,672,606	9,724,467,321
第7期計算期間	2021年2月18日～2022年2月17日	97,944,390	2,117,977,175	7,704,434,536
第8期計算期間	2022年2月18日～2023年2月17日	70,367,550	804,261,025	6,970,541,061
第9期中間計算期間	2023年2月18日～2023年8月17日	40,261,661	443,134,967	6,567,667,755

(注1) 第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2) 当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

(参考)

中小型株式 マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	22,572,089,000	94.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,248,417,457	5.24
合計(純資産総額)		23,820,506,457	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	富士電機	電気機器	100,000	6,315.00	631,500,000	6,746.00	674,600,000	2.83
日本	株式	ロート製薬	医薬品	160,000	3,349.08	535,854,192	4,055.00	648,800,000	2.72
日本	株式	竹内製作所	機械	122,000	4,474.60	545,901,896	4,900.00	597,800,000	2.51
日本	株式	MARUWA	ガラス・土石製品	25,000	22,290.00	557,250,000	23,480.00	587,000,000	2.46
日本	株式	東宝	情報・通信業	115,000	5,466.00	628,590,000	5,102.00	586,730,000	2.46
日本	株式	イビデン	電気機器	72,000	8,123.41	584,885,985	7,964.00	573,408,000	2.41
日本	株式	カブコン	情報・通信業	105,000	5,634.89	591,664,207	5,385.00	565,425,000	2.37
日本	株式	ナカニシ	精密機器	159,000	3,330.00	529,470,000	3,495.00	555,705,000	2.33
日本	株式	京都銀行	銀行業	65,000	7,564.93	491,720,915	8,423.00	547,495,000	2.30
日本	株式	寿スビリツ	食料品	225,000	2,107.14	474,108,302	2,417.00	543,825,000	2.28
日本	株式	物語コーポレーション	小売業	130,000	3,450.00	448,500,000	4,130.00	536,900,000	2.25
日本	株式	エンプラス	電気機器	50,000	7,010.89	350,544,974	10,470.00	523,500,000	2.20
日本	株式	トリケミカル研究所	化学	162,000	2,836.92	459,582,344	3,100.00	502,200,000	2.11
日本	株式	ニフコ	化学	126,000	4,267.00	537,642,000	3,869.00	487,494,000	2.05
日本	株式	ANYCOLOR	情報・通信業	135,000	3,801.88	513,254,251	3,515.00	474,525,000	1.99
日本	株式	ジャパンマテリアル	サービス業	205,000	2,381.00	488,105,000	2,294.00	470,270,000	1.97
日本	株式	パルグループホールディングス	小売業	240,000	1,960.31	470,474,996	1,938.00	465,120,000	1.95
日本	株式	弁護士ドットコム	サービス業	95,000	3,690.00	350,550,000	4,835.00	459,325,000	1.93
日本	株式	アシックス	その他製品	87,000	4,460.12	388,030,440	5,223.00	454,401,000	1.91
日本	株式	SHIFT	情報・通信業	16,500	27,517.54	454,039,569	27,310.00	450,615,000	1.89
日本	株式	横河ブリッジホールディングス	金属製品	160,000	2,540.23	406,438,013	2,794.00	447,040,000	1.88
日本	株式	シンプレクス・ホールディングス	情報・通信業	160,000	2,638.00	422,080,000	2,708.00	433,280,000	1.82
日本	株式	神戸物産	卸売業	115,000	3,752.23	431,507,291	3,506.00	403,190,000	1.69
日本	株式	ジャパンエレベーターサービスホールディングス	サービス業	180,000	1,879.25	338,265,715	2,195.00	395,100,000	1.66
日本	株式	三益半導体工業	金属製品	140,000	3,088.54	432,396,588	2,781.00	389,340,000	1.63
日本	株式	ティーケーピー	不動産業	140,000	2,724.38	381,414,224	2,606.00	364,840,000	1.53
日本	株式	ビジョン	情報・通信業	240,000	1,822.00	437,280,000	1,510.00	362,400,000	1.52
日本	株式	日本セラミック	電気機器	124,500	2,730.18	339,907,410	2,664.00	331,668,000	1.39
日本	株式	インターネットイニシアティブ	情報・通信業	135,000	2,713.66	366,345,355	2,417.50	326,362,500	1.37
日本	株式	ダイセキ	サービス業	80,000	4,150.48	332,038,982	4,000.00	320,000,000	1.34

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	食料品	2.76
		繊維製品	1.17
		化学	5.27
		医薬品	3.87
		ガラス・土石製品	2.46
		金属製品	3.51
		機械	4.55
		電気機器	10.39
		輸送用機器	0.43
		精密機器	2.33
		その他製品	4.01
		電気・ガス業	1.06
		陸運業	1.25
		情報・通信業	20.71
		卸売業	3.53
		小売業	5.22
		銀行業	2.30
		保険業	1.62
		その他金融業	1.10
		不動産業	3.63
サービス業	13.58		
	小計	94.76	
合計		94.76	

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	567,182,679,660	98.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	7,787,912,121	1.35
合計(純資産総額)		574,970,591,781	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	5,971,395,000	1.04

(注1) 評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	9,461,500	1,933.20	18,290,971,800	2,677.50	25,333,166,250	4.41
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,218,900	13,273.18	16,178,679,102	12,240.00	14,919,336,000	2.59
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,628,200	929.89	9,883,056,898	1,268.50	13,481,871,700	2.34
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	55,359,900	162.74	9,009,270,126	176.60	9,776,558,340	1.70
日本	株式	キーエンス	電気機器	172,400	68,599.15	11,826,493,460	55,500.00	9,568,200,000	1.66
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,206,100	5,657.14	6,823,076,554	7,347.00	8,861,216,700	1.54
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,111,500	5,920.19	6,580,291,185	7,128.00	7,922,772,000	1.38
日本	株式	日立製作所	電気機器	846,300	8,140.92	6,889,660,596	9,275.00	7,849,432,500	1.37
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	364,700	19,731.43	7,196,052,521	20,440.00	7,454,468,000	1.30
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,529,400	4,537.53	6,939,698,382	4,641.00	7,097,945,400	1.23
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,202,100	1,343.43	5,645,241,210	1,682.00	7,067,932,200	1.23
日本	株式	三井物産	卸売業	1,275,600	4,643.81	5,923,644,036	5,423.00	6,917,578,800	1.20
日本	株式	任天堂	その他製品	1,087,900	5,913.83	6,433,655,657	6,230.00	6,777,617,000	1.18
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,454,300	2,077.66	5,099,200,938	2,541.00	6,236,376,300	1.08
日本	株式	信越化学工業	化学	1,434,700	4,405.13	6,320,040,011	4,343.00	6,230,902,100	1.08
日本	株式	第一三共	医薬品	1,505,500	4,542.39	6,838,568,145	4,106.00	6,181,583,000	1.08
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,335,400	4,356.19	5,817,256,126	4,577.00	6,112,125,800	1.06
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,123,400	4,952.08	5,563,166,672	5,406.00	6,073,100,400	1.06
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,311,400	4,444.89	5,829,028,746	4,609.00	6,044,242,600	1.05
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,677,400	3,112.44	5,220,806,856	3,465.00	5,812,191,000	1.01
日本	株式	HOYA	精密機器	365,100	17,157.02	6,264,028,002	15,325.00	5,595,157,500	0.97
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	852,500	5,557.36	4,737,649,400	6,335.00	5,400,587,500	0.94

日本	株式	ダイキン工業	機械	207,800	26,765.02	5,561,771,156	23,475.00	4,878,105,000	0.85
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,778,000	1,511.19	4,198,085,820	1,690.50	4,696,209,000	0.82
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	937,500	5,374.73	5,038,809,375	4,909.00	4,602,187,500	0.80
日本	株式	村田製作所	電気機器	1,567,800	2,752.68	4,315,656,930	2,734.00	4,286,365,200	0.75
日本	株式	SMC	機械	56,400	74,555.98	4,204,957,272	66,980.00	3,777,672,000	0.66
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	628,300	6,147.32	3,862,361,156	5,855.00	3,678,696,500	0.64
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,031,000	3,083.36	3,178,944,160	3,440.00	3,546,640,000	0.62
日本	株式	パナソニック ホールディングス	電気機器	2,055,600	1,455.41	2,991,740,796	1,682.00	3,457,519,200	0.60

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.40
		建設業	2.12
		食料品	3.36
		繊維製品	0.42
		パルプ・紙	0.18
		化学	5.71
		医薬品	5.04
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.70
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	1.00
		非鉄金属	0.65
		金属製品	0.50
		機械	5.27
		電気機器	16.40
		輸送用機器	8.73
		精密機器	2.25
		その他製品	2.22
		電気・ガス業	1.38
陸運業	2.88		
海運業	0.67		
空運業	0.47		
倉庫・運輸関連業	0.14		
情報・通信業	7.94		
卸売業	6.70		

	小売業	4.27
	銀行業	7.04
	証券、商品先物取引業	0.77
	保険業	2.40
	その他金融業	1.20
	不動産業	1.91
	サービス業	4.65
	小計	98.65
合計		98.65

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	257円		6,069,288,100	5,971,395,000	1.04

(注 1) 評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注 2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	11,690,404,280	97.27
投資証券	日本	149,444,400	1.24
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	178,113,932	1.48
合計(純資産総額)		12,017,962,612	100.00

(注 1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注 2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	176,586,000	1.47

(注 1) 評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注 2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	375,100	1,882.86	706,262,894	2,677.50	1,004,330,250	8.36
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	44,600	11,882.40	529,955,043	12,240.00	545,904,000	4.54
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	16,700	16,401.36	273,902,798	20,440.00	341,348,000	2.84
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	44,900	5,414.01	243,089,371	7,347.00	329,880,300	2.74
日本	株式	日立製作所	電気機器	33,200	7,289.71	242,018,388	9,275.00	307,930,000	2.56
日本	株式	第一三共	医薬品	65,400	4,547.39	297,399,667	4,106.00	268,532,400	2.23
日本	株式	三井物産	卸売業	46,400	4,028.93	186,942,380	5,423.00	251,627,200	2.09
日本	株式	KDDI	情報・通信業	52,900	4,068.78	215,238,717	4,577.00	242,123,300	2.01
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	51,000	3,742.46	190,865,751	4,609.00	235,059,000	1.96
日本	株式	任天堂	その他製品	36,800	5,305.63	195,247,380	6,230.00	229,264,000	1.91
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	42,000	4,234.75	177,859,645	5,406.00	227,052,000	1.89
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	63,800	2,564.18	163,594,806	3,465.00	221,067,000	1.84
日本	株式	ダイキン工業	機械	9,300	23,495.80	218,510,940	23,475.00	218,317,500	1.82
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	85,300	2,067.94	176,395,565	2,541.00	216,747,300	1.80
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	6,200	29,692.91	184,096,097	32,590.00	202,058,000	1.68
日本	株式	HOYA	精密機器	12,500	17,497.24	218,715,500	15,325.00	191,562,500	1.59
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	38,600	4,639.05	179,067,438	4,909.00	189,487,400	1.58
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	101,600	1,506.30	153,040,710	1,690.50	171,754,800	1.43
日本	株式	村田製作所	電気機器	60,900	2,609.80	158,936,968	2,734.00	166,500,600	1.39
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	64,000	1,909.63	122,216,631	2,074.00	132,736,000	1.10
日本	株式	小松製作所	機械	32,700	3,251.34	106,319,121	4,043.00	132,206,100	1.10
日本	株式	パナソニックホールディングス	電気機器	78,100	1,268.02	99,032,473	1,682.00	131,364,200	1.09
日本	株式	ファナック	電気機器	33,700	4,573.81	154,137,590	3,893.00	131,194,100	1.09
日本	株式	丸紅	卸売業	51,100	1,779.81	90,948,388	2,332.00	119,165,200	0.99
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	20,200	5,267.33	106,400,237	5,829.00	117,745,800	0.98
日本	株式	オリックス	その他金融業	41,500	2,194.40	91,067,715	2,793.00	115,909,500	0.96
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	13,200	6,841.22	90,304,200	8,658.00	114,285,600	0.95
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	27,200	3,049.98	82,959,494	4,181.00	113,723,200	0.95
日本	株式	富士通	電気機器	6,200	17,947.30	111,273,260	17,600.00	109,120,000	0.91
日本	株式	日本製鉄	鉄鋼	30,300	3,015.81	91,379,061	3,505.00	106,201,500	0.88

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	鉱業	0.64
		建設業	1.71
		食料品	3.41
		繊維製品	0.42
		化学	5.47
		医薬品	5.00
		石油・石炭製品	0.50
		ゴム製品	0.99
		ガラス・土石製品	0.39
		鉄鋼	1.41
		非鉄金属	0.60
		金属製品	0.15
		機械	5.66
		電気機器	20.53
		輸送用機器	8.86
		精密機器	2.01
		その他製品	2.72
		電気・ガス業	1.10
		陸運業	2.68
		海運業	0.55
		空運業	0.15
		倉庫・運輸関連業	0.01
		情報・通信業	5.61
		卸売業	5.12
		小売業	3.45
		銀行業	5.61
		証券、商品先物取引業	0.87
		保険業	3.46
その他金融業	1.03		
不動産業	2.26		
サービス業	4.91		
	小計	97.27	
投資証券	—	—	1.24
合計			98.52

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	ミニTOPIX先物	買建	76円		179,318,338	176,586,000	1.47

(注1) 評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	401,505,357,979	68.05
	イギリス	24,048,770,892	4.08
	カナダ	19,977,364,676	3.39
	フランス	18,086,055,796	3.07
	スイス	18,068,171,667	3.06
	ドイツ	13,551,974,450	2.30
	オーストラリア	11,001,412,050	1.86
	アイルランド	10,637,436,027	1.80
	オランダ	10,433,331,381	1.77
	デンマーク	5,449,818,244	0.92
	スウェーデン	4,702,722,134	0.80
	スペイン	4,217,731,360	0.71
	イタリア	3,092,605,394	0.52
	香港	2,806,932,492	0.48
	シンガポール	1,923,319,127	0.33
	フィンランド	1,799,404,712	0.30
	ジャージー	1,693,259,960	0.29
	ベルギー	1,275,022,972	0.22
	ノルウェー	1,198,262,968	0.20
	イスラエル	1,153,389,469	0.20
	キュラソー	962,258,635	0.16
	パミューダ	929,956,200	0.16
ケイマン	836,634,552	0.14	
ニュージーランド	425,919,421	0.07	
ルクセンブルク	344,609,293	0.06	
オーストリア	328,501,688	0.06	
ポルトガル	317,459,559	0.05	

	リベリア	240,992,688	0.04
	パナマ	155,104,947	0.03
	マン島	83,795,416	0.01
	小計	561,247,576,149	95.12
新株予約権証券	カナダ	—	—
投資信託受益証券	オーストラリア	110,654,920	0.02
	香港	49,060,147	0.01
	小計	159,715,067	0.03
投資証券	アメリカ	9,370,596,574	1.59
	オーストラリア	684,045,509	0.12
	シンガポール	237,310,576	0.04
	フランス	215,548,708	0.04
	イギリス	159,430,686	0.03
	香港	117,850,510	0.02
	カナダ	55,301,186	0.01
	ベルギー	46,684,626	0.01
	小計	10,886,768,375	1.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	17,722,711,493	3.00
合計(純資産総額)		590,016,771,084	100.00

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 ／ 売建	国／地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	13,008,505,162	2.20
	買建	カナダ	627,071,894	0.11
	買建	ドイツ	2,595,246,554	0.44
	買建	イギリス	893,842,108	0.15
	買建	オーストラリア	592,738,230	0.10

(注1) 評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

資産の種類	買建 ／ 売建	国／地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建	—	730,540,746	0.12

(注1) 評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,177,684	26,243.40	30,906,438,684	25,531.81	30,068,404,364	5.10
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	528,983	49,785.90	26,335,897,323	46,914.27	24,816,851,922	4.21
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	690,901	17,984.16	12,425,277,477	18,844.08	13,019,399,520	2.21
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	184,802	58,347.30	10,782,697,976	64,452.52	11,910,955,747	2.02
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	444,829	18,647.40	8,294,907,661	19,790.92	8,803,579,512	1.49
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	395,244	18,761.81	7,415,496,547	19,913.58	7,870,725,148	1.33
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	213,419	29,057.98	6,201,526,534	36,853.52	7,865,241,470	1.33
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	165,576	39,224.35	6,494,611,642	45,466.33	7,528,134,182	1.28
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	301,729	15,701.41	4,737,571,523	17,870.32	5,391,994,568	0.91
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	69,912	72,038.12	5,036,329,315	76,300.75	5,334,338,593	0.90
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	97,275	48,003.94	4,669,583,360	53,409.03	5,195,363,860	0.88
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	60,535	63,847.83	3,865,028,661	81,438.83	4,929,899,635	0.84
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	217,897	20,481.98	4,462,964,044	22,076.51	4,810,405,779	0.82
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	179,427	23,087.67	4,142,551,904	23,466.11	4,210,453,791	0.71
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	120,784	33,651.01	4,064,503,906	34,651.70	4,185,371,271	0.71
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	177,374	21,763.67	3,860,310,044	21,889.53	3,882,634,771	0.66
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	30,991	121,568.15	3,767,518,642	124,450.56	3,856,847,305	0.65
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	63,267	55,998.26	3,542,842,206	59,748.23	3,780,091,596	0.64
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	135,745	23,060.49	3,130,346,567	25,516.85	3,463,785,102	0.59

			ー						
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	75,273	43,801.51	3,297,071,167	45,396.03	3,417,095,682	0.58
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	246,100	12,052.87	2,966,211,799	13,805.28	3,397,480,638	0.58
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	199,766	18,310.78	3,657,873,115	16,820.03	3,360,070,912	0.57
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	133,056	20,599.57	2,740,896,436	22,773.55	3,030,158,134	0.51
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	191,177	16,610.69	3,175,582,369	15,601.19	2,982,589,465	0.51
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	32,965	75,875.95	2,501,250,719	85,055.67	2,803,860,340	0.48
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	110,203	21,901.50	2,413,611,401	24,312.73	2,679,336,137	0.45
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	29,993	107,752.83	3,231,830,930	87,026.39	2,610,182,815	0.44
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	102,377	27,456.90	2,810,955,542	25,353.80	2,595,647,006	0.44
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	34,096	62,134.03	2,118,522,098	75,488.53	2,573,857,212	0.44
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	305,497	9,013.69	2,753,655,499	8,348.05	2,550,307,225	0.43

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.43
		素材	3.92
		資本財	6.48
		商業・専門サービス	1.51
		運輸	1.75
		自動車・自動車部品	2.15
		耐久消費財・アパレル	1.46
		消費者サービス	2.05

		メディア・娯楽	6.01
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.28
		生活必需品流通・小売り	1.69
		食品・飲料・タバコ	3.69
		家庭用品・パーソナル用品	1.68
		ヘルスケア機器・サービス	4.39
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.37
		銀行	5.23
		金融サービス	6.40
		保険	3.07
		エクイティ不動産投資信託 (REIT)	0.04
		ソフトウェア・サービス	9.13
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.54
		電気通信サービス	1.13
		公益事業	2.61
		半導体・半導体製造装置	5.79
		不動産管理・開発	0.32
		小計	95.12
新株予約権証券	—	—	—
投資信託受益証券	—	—	0.03
投資証券	—	—	1.85
合計			97.00

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	401	アメリカドル	90,274,284.55	13,503,227,482	86,966,875	13,008,505,162	2.20
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	24	カナダドル	5,805,348	642,884,237	5,662,560	627,071,894	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	46	スイスフラン	5,080,492	830,457,222	5,038,380	823,573,594	0.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	268	ユーロ	11,425,647.6	1,805,252,321	11,213,120	1,771,672,960	0.30
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	35	オーストラリアドル	6,375,395	612,420,444	6,170,500	592,738,230	0.10
	イギリス	ロンドン国際金融先物	FTSE 100	買建	64	イギリスポンド	4,879,485	890,652,396	4,896,960	893,842,108	0.15

		オプション取引所								
--	--	----------	--	--	--	--	--	--	--	--

(注 1) 評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注 2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

種類	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	4,340,000.00	648,818,900	648,831,396	0.11
	スイスフラン	買建	500,000.00	81,690,000	81,709,350	0.01

(注 1) 評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注 2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	8,445,930,191	68.44
	イギリス	486,489,864	3.94
	フランス	444,481,102	3.60
	カナダ	420,957,563	3.41
	アイルランド	336,055,438	2.72
	スイス	312,289,962	2.53
	オランダ	262,431,813	2.13
	デンマーク	208,885,832	1.69
	オーストラリア	178,669,324	1.45
	ドイツ	167,872,821	1.36
	スウェーデン	101,971,800	0.83
	香港	63,713,867	0.52
	スペイン	63,484,293	0.51
	イタリア	59,486,082	0.48
	フィンランド	54,905,164	0.44
	ノルウェー	43,159,850	0.35
	キュラソー	41,192,516	0.33
	ジャージー	41,008,692	0.33
	シンガポール	22,895,880	0.19
	バミューダ	22,525,120	0.18
ニュージーランド	12,484,653	0.10	
ベルギー	10,172,890	0.08	
ポルトガル	6,085,723	0.05	
オーストリア	5,625,160	0.05	

	イスラエル	5,560,941	0.05
	ルクセンブルク	4,220,417	0.03
	ケイマン	1,848,319	0.01
	小計	11,824,405,277	95.82
投資信託受益証券	オーストラリア	3,549,984	0.03
	香港	1,713,211	0.01
	小計	5,263,195	0.04
投資証券	アメリカ	204,737,406	1.66
	オーストラリア	25,395,913	0.21
	イギリス	4,591,324	0.04
	フランス	3,856,208	0.03
	シンガポール	2,962,151	0.02
	カナダ	2,485,371	0.02
	小計	244,028,373	1.98
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	266,957,313	2.16
合計(純資産総額)		12,340,654,158	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 ／ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	194,640,975	1.58
	買建	ドイツ	39,664,320	0.32

(注1) 評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	22,195	49,898.58	1,107,499,013	46,914.27	1,041,262,249	8.44
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	7,761	63,391.68	491,982,893	64,452.52	500,216,056	4.05
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	18,668	18,408.90	343,657,440	19,790.92	369,457,078	2.99
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	16,612	18,490.35	307,161,850	19,913.58	330,804,481	2.68
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・	8,971	38,242.50	343,073,505	36,853.52	330,612,932	2.68

			自動車部品							
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,535	69,733.07	176,773,333	81,438.83	206,447,437	1.67	
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7,566	24,675.62	186,695,782	23,466.11	177,544,591	1.44	
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	5,085	34,389.55	174,870,892	34,651.70	176,203,909	1.43	
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	7,433	22,217.67	165,143,995	21,889.53	162,704,930	1.32	
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	2,659	57,035.88	151,658,421	59,748.23	158,870,557	1.29	
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	3,159	45,075.32	142,392,938	45,396.03	143,406,072	1.16	
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10,204	11,664.85	119,028,183	13,805.28	140,869,128	1.14	
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7,973	17,034.31	135,814,584	15,601.19	124,388,320	1.01	
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	4,348	27,658.83	120,260,628	25,353.81	110,238,366	0.89	
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	1,261	100,334.89	126,522,298	87,026.39	109,740,290	0.89	
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	1,432	72,847.33	104,317,382	75,488.53	108,099,587	0.88	
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	12,929	9,103.09	117,693,973	8,348.05	107,932,065	0.87	
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6,445	14,835.65	95,615,772	15,317.83	98,723,457	0.80	
イギリス	株式	ASTRAZENECA	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,877	20,792.96	101,407,314	20,089.25	97,975,281	0.79	
フランス	株式	LVMH	耐久消費財・アパレル	868	129,827.84	112,690,571	111,548.00	96,823,664	0.78	
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	3,061	31,361.50	95,997,575	30,394.65	93,038,042	0.75	

アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	2,294	43,119.39	98,915,901	39,726.95	91,133,628	0.74
アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	1,982	44,869.01	88,930,393	44,989.17	89,168,548	0.72
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	13,070	6,043.95	78,994,555	6,710.15	87,701,776	0.71
アイルランド	株式	LINDE PLC	素材	1,538	55,523.99	85,395,899	55,866.63	85,922,883	0.70
アメリカ	株式	DANAHER CORP	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,203	35,847.89	78,972,907	36,974.67	81,455,220	0.66
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	62,116	1,104.15	68,585,627	1,177.13	73,118,977	0.59
フランス	株式	TOTALENERGIES SE	エネルギー	7,065	8,334.14	58,880,763	10,051.95	71,017,097	0.58
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	13,107	4,955.78	64,955,451	5,262.22	68,971,975	0.56
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	5,742	13,083.29	75,124,269	11,985.84	68,822,724	0.56

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	3.52
		素材	3.98
		資本財	5.94
		商業・専門サービス	1.83
		運輸	2.51
		自動車・自動車部品	3.19
		耐久消費財・アパレル	2.29
		消費者サービス	1.71
		メディア・娯楽	7.59
		一般消費財・サービス流通・小売り	3.32
		生活必需品流通・小売り	0.90
		食品・飲料・タバコ	2.93
		家庭用品・パーソナル用品	3.05
		ヘルスケア機器・サービス	2.64
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10.27
		銀行	3.80
		金融サービス	7.30
		保険	3.51
		エクイティ不動産投資信託 (REIT)	0.08
		ソフトウェア・サービス	14.48

		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.57
		電気通信サービス	1.07
		公益事業	1.78
		半導体・半導体製造装置	7.31
		不動産管理・開発	0.25
		小計	95.82
投資信託受益証券	—	—	0.04
投資証券	—	—	1.98
合計			97.84

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	6	アメリカドル	1,309,237.3	195,835,715	1,301,250	194,640,975	1.58
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	6	ユーロ	253,639.2	40,074,994	251,040	39,664,320	0.32

(注 1) 評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注 2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

新興国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	ケイマン	25,544,798,624	16.12
	インド	24,172,969,132	15.25
	台湾	22,196,375,022	14.01
	韓国	18,783,685,843	11.85
	中国	17,334,348,922	10.94
	ブラジル	7,849,290,576	4.95
	サウジアラビア	6,408,016,295	4.04
	南アフリカ	4,336,841,902	2.74
	メキシコ	3,707,861,763	2.34
	インドネシア	3,043,727,108	1.92
	タイ	2,856,111,255	1.80

	アラブ首長国連邦	2,199,506,548	1.39
	マレーシア	2,161,476,562	1.36
	香港	1,480,828,648	0.93
	カタール	1,456,032,144	0.92
	クウェート	1,268,994,166	0.80
	トルコ	1,134,263,590	0.72
	ポーランド	1,023,323,213	0.65
	フィリピン	960,425,115	0.61
	チリ	749,221,114	0.47
	アメリカ	727,548,870	0.46
	ギリシャ	658,022,615	0.42
	バミューダ	626,978,543	0.40
	ハンガリー	363,978,472	0.23
	チェコ	251,537,128	0.16
	ルクセンブルク	198,147,800	0.13
	イギリス	163,875,726	0.10
	コロンビア	146,155,217	0.09
	エジプト	78,781,632	0.05
	シンガポール	25,037,731	0.02
	ペルー	21,499,986	0.01
	オランダ	16,221,009	0.01
	ロシア	117	0.00
	キプロス	—	—
	英ヴァージン諸島	—	—
	小計	151,945,882,388	95.89
投資信託受益証券	ブラジル	340,695,987	0.22
	メキシコ	114,555,134	0.07
	小計	455,251,121	0.29
投資証券	メキシコ	93,845,186	0.06
	南アフリカ	38,870,151	0.02
	小計	132,715,337	0.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	5,925,761,193	3.74
合計(純資産総額)		158,459,610,039	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 ／ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,959,917,873	3.76

(注1) 評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。この

ような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建	—	141, 111, 195	0.09
	売建	—	2, 082, 369	△0.00

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートをを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	3, 886, 389	2, 048. 91	7, 962, 882, 311	2, 424. 05	9, 420, 811, 749	5. 95
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	1, 059, 100	5, 000. 30	5, 295, 826, 621	5, 683. 31	6, 019, 197, 857	3. 80
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	750, 499	6, 956. 50	5, 220, 848, 745	7, 599. 24	5, 703, 222, 021	3. 60
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	2, 603, 988	1, 413. 07	3, 679, 622, 107	1, 586. 12	4, 130, 263, 486	2. 61
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	481, 342	4, 214. 31	2, 028, 527, 190	4, 224. 54	2, 033, 448, 533	1. 28
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	806, 150	2, 680. 59	2, 160, 963, 142	2, 117. 38	1, 706, 932, 336	1. 08
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	532, 498	2, 684. 33	1, 429, 405, 063	2, 605. 49	1, 387, 420, 876	0. 88
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	812, 223	1, 638. 70	1, 330, 995, 394	1, 706. 28	1, 385, 885, 546	0. 87
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC-ADR	一般消費財・サービス流通・小売り	94, 486	10, 237. 42	967, 292, 942	14, 301. 34	1, 351, 276, 770	0. 85
インド	株式	HDFC BANK LTD	銀行	461, 405	2, 741. 64	1, 265, 009, 728	2, 756. 53	1, 271, 881, 108	0. 80
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	15, 201, 620	87. 23	1, 326, 145, 748	83. 31	1, 266, 592, 898	0. 80
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	87, 370	10, 063. 00	879, 204, 544	12, 743. 17	1, 113, 370, 763	0. 70
ブラジル	株式	VALE SA	素材	525, 387	2, 236. 82	1, 175, 197, 199	1, 980. 30	1, 040, 425, 447	0. 66
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび	1, 938, 248	474. 92	920, 528, 122	482. 02	934, 292, 908	0. 59

			機器						
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	143,181	5,838.12	835,908,859	6,402.42	916,705,256	0.58
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	313,630	1,999.16	626,997,308	2,889.43	906,212,558	0.57
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	1,058,000	761.05	805,197,532	840.84	889,608,720	0.56
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	351,450	1,766.14	620,712,082	2,461.36	865,047,784	0.55
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	307,532	3,335.62	1,025,810,849	2,712.60	834,212,841	0.53
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	241,804	3,007.10	727,129,808	3,406.65	823,741,959	0.52
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	133,027	6,266.65	833,634,957	6,054.95	805,471,834	0.51
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	一般消費財・サービス流通・小売り	379,111	3,241.84	1,229,020,903	2,123.12	804,898,525	0.51
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	169,000	3,920.47	662,560,207	4,490.85	758,953,650	0.48
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	8,689,300	86.15	748,651,022	86.08	748,040,114	0.47
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	728,040	795.46	579,132,416	1,022.81	744,646,713	0.47
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	一般消費財・サービス流通・小売り	30,591	18,612.87	569,386,398	23,706.23	725,197,331	0.46
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	10,056,515	70.91	713,128,466	70.70	711,066,006	0.45
韓国	株式	POSCO HOLDINGS INC	素材	11,785	33,212.01	391,403,651	59,438.50	700,482,723	0.44
インド	株式	AXIS BANK LTD	銀行	359,795	1,580.75	568,746,973	1,866.56	671,579,855	0.42
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	594,100	889.20	528,277,590	1,113.66	661,625,790	0.42

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.04
		素材	7.60
		資本財	4.51
		商業・専門サービス	0.04
		運輸	2.00
		自動車・自動車部品	3.65
		耐久消費財・アパレル	1.27

		消費者サービス	2.60
		メディア・娯楽	6.39
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.53
		生活必需品流通・小売り	1.52
		食品・飲料・タバコ	3.55
		家庭用品・パーソナル用品	0.75
		ヘルスケア機器・サービス	1.02
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.67
		銀行	15.98
		金融サービス	2.60
		保険	2.74
		ソフトウェア・サービス	2.47
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.55
		電気通信サービス	2.68
		公益事業	2.49
		半導体・半導体製造装置	8.66
		不動産管理・開発	1.58
		小計	95.89
投資信託受益証券	—	—	0.29
投資証券	—	—	0.08
合計			96.26

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	834	アメリカドル	41,022,571	6,136,156,170	39,844,350	5,959,917,873	3.76

(注 1) 評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注 2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

種類	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	930,000.00	139,026,300	139,032,189	0.09
	ブラジルリアル	買建	70,024.50	2,084,368	2,079,006	0.00
	アメリカドル	売建	13,928.29	2,084,368	2,082,369	△0.00

(注 1) 評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値

が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートをを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

J-REITインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	126,597,388,300	96.79
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	4,192,637,384	3.21
合計(純資産総額)		130,790,025,684	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	4,171,750,000	3.19

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	13,980	632,461.57	8,841,812,806	606,000	8,471,880,000	6.48
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	12,309	594,000.35	7,311,550,311	583,000	7,176,147,000	5.49
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	38,751	167,143.98	6,476,996,443	167,400	6,486,917,400	4.96
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	20,875	311,180.52	6,495,893,551	279,200	5,828,300,000	4.46
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	57,439	106,366.32	6,109,575,385	97,000	5,571,583,000	4.26
日本	投資証券	GLP投資法人	40,478	150,529.06	6,093,115,440	133,700	5,411,908,600	4.14
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	18,063	299,255.06	5,405,444,231	263,800	4,765,019,400	3.64
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	23,877	187,732.05	4,482,478,351	179,400	4,283,533,800	3.28
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	26,806	153,502.58	4,114,790,355	155,700	4,173,694,200	3.19
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	11,757	336,749.83	3,959,167,768	339,000	3,985,623,000	3.05
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	58,020	47,822.22	2,774,645,358	61,800	3,585,636,000	2.74
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	40,114	74,556.82	2,990,772,514	78,100	3,132,903,400	2.40
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	36,009	79,716.35	2,870,506,313	83,300	2,999,549,700	2.29
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	8,201	385,154.63	3,158,653,120	361,000	2,960,561,000	2.26
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	4,138	622,012.94	2,573,889,583	631,000	2,611,078,000	2.00

日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	6,287	428,262.98	2,692,489,356	412,500	2,593,387,500	1.98
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	18,284	154,838.27	2,831,063,050	138,200	2,526,848,800	1.93
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	6,973	333,630.79	2,326,407,520	346,000	2,412,658,000	1.84
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,984	491,627.33	2,450,270,636	471,000	2,347,464,000	1.79
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,676	318,659.9	2,446,033,455	289,900	2,225,272,400	1.70
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	15,318	161,459.4	2,473,235,190	143,400	2,196,601,200	1.68
日本	投資証券	イオンリート投資法人	14,699	158,315.75	2,327,083,223	146,500	2,153,403,500	1.65
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	4,446	512,003.08	2,276,365,729	457,500	2,034,045,000	1.56
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	8,797	210,368.08	1,850,608,067	228,300	2,008,355,100	1.54
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	14,091	158,140.75	2,228,361,340	141,700	1,996,694,700	1.53
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,893	312,900.76	1,843,924,185	331,500	1,953,529,500	1.49
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	16,625	115,782.29	1,924,880,649	110,900	1,843,712,500	1.41
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	11,212	169,571.74	1,901,238,374	159,400	1,787,192,800	1.37
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	23,098	73,698.71	1,702,293,011	72,800	1,681,534,400	1.29
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,482	664,956.25	1,650,421,419	668,000	1,657,976,000	1.27

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

(注3) 銘柄コードの変更等、管理の都合上により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	96.79
合計	96.79

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	2,255	円	4,194,537,860	4,171,750,000	3.19

(注1) 評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

グローバルREITインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
-------	------	----------	----------

投資証券	アメリカ	70,721,190,515	77.72
	オーストラリア	5,953,212,201	6.54
	イギリス	3,991,670,144	4.39
	シンガポール	3,288,491,481	3.61
	フランス	1,522,320,376	1.67
	カナダ	1,462,449,571	1.61
	香港	1,046,509,395	1.15
	ベルギー	928,004,658	1.02
	スペイン	364,691,871	0.40
	ニュージーランド	264,573,589	0.29
	韓国	175,865,273	0.19
	オランダ	169,938,603	0.19
	ガーンジー	155,445,808	0.17
	イスラエル	120,120,134	0.13
	ドイツ	36,888,260	0.04
	アイルランド	30,558,780	0.03
	イタリア	11,051,357	0.01
	小計	90,242,982,016	99.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	752,757,805	0.83
合計(純資産総額)		90,995,739,821	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 ／ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建	—	189,813,544	0.21

(注1) 評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	473,082	16,500.60	7,806,139,505	16,772.40	7,934,723,091	8.72
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	47,941	91,738.93	4,398,056,107	107,842.69	5,170,086,526	5.68
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	266,048	10,253.38	2,727,893,521	12,035.20	3,201,942,699	3.52
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	80,738	42,686.99	3,446,462,443	39,531.00	3,191,654,072	3.51
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	155,277	14,833.92	2,303,367,187	17,731.21	2,753,249,592	3.03

アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	167,011	16,924.64	2,826,602,404	16,278.79	2,718,737,231	2.99
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	363,625	9,341.85	3,396,931,431	7,422.15	2,698,882,785	2.97
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	517,605	4,720.74	2,443,483,182	4,408.12	2,281,666,298	2.51
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	107,970	20,751.62	2,240,553,043	18,072.25	1,951,261,437	2.14
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	72,947	24,021.66	1,752,308,702	25,621.55	1,869,015,806	2.05
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	880,109	1,676.40	1,475,415,804	2,072.97	1,824,443,778	2.00
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	177,351	8,965.49	1,590,039,648	8,790.81	1,559,060,115	1.71
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	295,891	4,500.21	1,331,572,949	4,750.66	1,405,677,775	1.54
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	149,244	7,460.42	1,113,423,080	8,955.35	1,336,532,942	1.47
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	204,850	6,327.66	1,296,221,289	6,312.27	1,293,069,739	1.42
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	79,777	20,969.09	1,672,851,317	14,854.78	1,185,070,566	1.30
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	59,739	22,801.88	1,362,161,995	19,286.84	1,152,176,845	1.27
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	63,768	20,075.35	1,280,165,092	17,708.77	1,129,253,241	1.24
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	32,893	31,336.19	1,030,741,454	31,523.98	1,036,918,439	1.14
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	135,479	7,491.58	1,014,952,244	6,895.63	934,214,141	1.03
香港	投資証券	LINK REIT	1,319,300	935.45	1,234,149,903	706.11	931,576,860	1.02
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	367,327	2,516.90	924,526,041	2,456.10	902,193,167	0.99
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	94,540	9,382.40	887,012,505	9,502.81	898,396,357	0.99
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	108,417	11,681.09	1,266,428,952	8,179.03	886,746,373	0.97
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	320,049	3,085.81	987,613,544	2,637.09	843,999,746	0.93
アメリカ	投資証券	UDR INC	156,501	5,672.69	887,783,104	5,335.51	835,013,996	0.92
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT-A	164,193	4,532.22	744,159,721	5,064.77	831,601,226	0.91
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	619,040	1,443.83	893,790,598	1,284.64	795,247,347	0.87
アメリカ	投資証券	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	104,776	8,050.88	843,539,824	7,422.15	777,664,194	0.85
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	54,497	16,332.48	890,071,352	14,153.25	771,310,188	0.85

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	99.17
合計	99.17

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	940,000.00	140,525,900	140,529,468	0.15
	オーストラリアドル	買建	280,000.00	26,624,640	26,882,716	0.03
	香港ドル	買建	600,000.00	11,463,000	11,459,040	0.01

	シンガポールドル	買建	100,000.00	10,938,300	10,942,320	0.01
--	----------	----	------------	------------	------------	------

(注1) 評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	29,780,035,257	103.15
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	—	△909,049,301	△3.15
合計（純資産総額）		28,870,985,956	100.00

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建	—	30,543,083,559	△105.79

(注1) 評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(％)
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	5,631,995	5,455.18	30,723,561,127	5,287.65	29,780,035,257	103.15

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	103.15
合計	103.15

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	204,393,300.00	29,622,904,922	30,543,083,559	△105.79

(注1) 評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
社債券	ケイマン	27,672,322,550	92.80
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	2,147,003,074	7.20
合計(純資産総額)		29,819,325,624	100.00

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
ケイマン	社債券	SIGNUM GENEVA1 0% 12/15/25	26,485,000,000	103.60	27,440,307,700	104.48	27,672,322,550	0.000	2025/12/15	92.80

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
社債券	92.80
合計	92.80

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

米国株式LSマザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
社債券	アイルランド	21,110,932,015	100.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	△130,748,704	△0.62
合計(純資産総額)		20,980,183,311	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建	—	20,929,476,000	△99.76

(注1) 評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 004 10/18/27	111,000,000	18,495.04	20,529,499,148	19,018.85	21,110,932,015	0.000	2027/10/18	100.62

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
社債券	100.62
合計	100.62

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 /	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率
----	-------	---------	----	-----------	-----------	----------

		売建				(%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	141,000,000.00	20,920,029,000	20,929,476,000	△99.76

(注1) 評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを採用しております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

コモディティLSアルファ・マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
社債券	アイルランド	17,139,690,000	92.99
	イギリス	1,065,350,000	5.78
	小計	18,205,040,000	98.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	225,769,594	1.22
合計(純資産総額)		18,430,809,594	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 0% 07/16/24	14,130,000,000	127.08	17,956,404,000	121.30	17,139,690,000	0.000	2024/7/16	92.99
イギリス	社債券	ソシエテ・ジェネラル 0% 2024/05/31	1,100,000,000	99.38	1,093,230,000	96.85	1,065,350,000	0.000	2024/5/31	5.78

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
社債券	98.78
合計	98.78

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

GBCAマザーファンド（ミドルリスク型）

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	11,826,206,960	56.37
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	—	9,154,671,924	43.63
合計（純資産総額）		20,980,878,884	100.00

（注1）国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

（注2）投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	日本	9,422,400,000	44.91
	買建	イギリス	4,814,761,737	22.95
	売建	アメリカ	10,793,382,454	△51.44
	売建	ドイツ	16,807,144,140	△80.11

（注1）評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

（注2）投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建	—	6,976,660,240	33.25
	売建	—	8,012,223,411	△38.19

（注1）評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

（注2）投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額（円） 単価	帳簿価額（円） 金額	評価額（円） 単価	評価額（円） 金額	利率（％）	償還期限	投資比率（％）
日本	国債証券	第1152回国庫短期証券	7,000,000,000	100.14	7,010,097,500	100.05	7,003,892,000	—	2024/4/22	33.38
日本	国債証券	第1115回国庫短期証券	2,120,000,000	100.06	2,121,399,200	100.00	2,120,207,760	—	2023/10/20	10.11
日本	国債証券	第1145回国庫短期証券	1,700,000,000	100.15	1,702,679,200	100.07	1,701,234,200	—	2024/3/21	8.11

日本	国債証券	第1183回国庫 短期証券	1,000,000,000	100.03	1,000,388,000	100.08	1,000,873,000	—	2024/9/20	4.77
----	------	------------------	---------------	--------	---------------	--------	---------------	---	-----------	------

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	56.37
合計	56.37

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	日本	大阪取引所	長期国債標準物先物	買建	65	円	9,485,881,450	9,485,881,450	9,422,400,000	9,422,400,000	44.91
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	売建	669	アメリカドル	72,969,988.42	10,914,850,867	72,157,925.22	10,793,382,454	△51.44
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	売建	837	ユーロ	109,165,642.3	17,248,171,483	106,374,330	16,807,144,140	△80.11
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	LONG GILT FU	買建	284	イギリスポンド	26,945,770	4,918,411,398	26,377,920	4,814,761,737	22.95

(注1) 評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

種類	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	4,778,000.00	709,663,940	712,701,768	3.40
	カナダドル	買建	3,199,000.00	353,805,633	353,344,905	1.68
	イギリスポンド	買建	3,096,000.00	560,306,620	563,585,003	2.69
	スウェーデンクローナ	買建	95,219,000.00	1,266,577,259	1,300,415,403	6.20
	ノルウェークローネ	買建	291,184,000.00	4,005,194,255	4,046,613,161	19.29
	ユーロ	売建	3,571,000.00	560,784,472	563,043,141	△2.68
	スイスフラン	売建	32,905,000.00	5,372,341,259	5,372,876,472	△25.61
	オーストラリアドル	売建	10,748,000.00	1,016,151,075	1,030,153,881	△4.91
	ニュージーランドドル	売建	11,762,000.00	1,032,209,385	1,046,149,917	△4.99

(注1) 評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
社債券	アイルランド	8,248,986,400	99.46
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	—	44,727,063	0.54
合計（純資産総額）		8,293,713,463	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 0% 10/18/24	9,188,000,000	89.88	8,258,258,800	89.78	8,248,986,400	0.000	2024/10/18	99.46

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
社債券	99.46
合計	99.46

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

運用実績

当初設定日：2015年6月16日
作成基準日：2023年9月29日

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額 13,886円

純資産総額 89.97億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2019年2月	0円
2020年2月	0円
2021年2月	0円
2022年2月	0円
2023年2月	0円
設定来 分配金合計額	0円

※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
国内株式インデックス マザーファンド	7.4%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	6.9%
FOFs用国内株式EVIバリューファンド(適格機関投資家専用)	6.2%
国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	6.1%
J-REIT インデックス マザーファンド	6.1%
グローバルREITインデックス マザーファンド	4.9%
外国株式インデックス マザーファンド	4.4%
ニッセイ/サンダース・グローバルバリュー株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	4.2%
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	4.1%
グローバル株式コンセントレイト・ファンド(適格機関投資家専用)	4.1%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2015年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2023年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページ等でご確認いただけます。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

<申込手続>

受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

<申込コース>

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」(※)の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

※「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

<申込みの受付>

お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

<申込単位>

販売会社が定める単位とします（「分配金再投資コース」を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1円以上1円単位とします。）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

<申込価額>

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

(注) 分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の申込価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

<申込手数料>

前記 第1ファンドの状況 4 手数料等及び税金 (1) 申込手数料をご覧ください。

<申込代金の支払い>

販売会社が定める期日までにお支払いください。

<受付不可日>

収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

<申込受付の中止等>

収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができ

ます。

<その他>

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

<問い合わせ先>

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

2【換金（解約）手続等】

<一部解約手続>

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとし、委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

<一部解約の受付>

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。なお、当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

<一部解約単位>

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

<解約価額>

一部解約の実行の請求受付日の翌々営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<https://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

<一部解約代金の支払い>

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、7営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

<受付不可日>

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

<一部解約受付の中止等>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記<解約価額>の規定に準じて計算された価額とします。

<一部解約の制限>

当ファンドの規模及び商品性格などにに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の一部解約には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

<その他>

一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

<問い合わせ先>

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口当たりに換算した価額で表示することがあります。

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

①国内投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法

計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。

②外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）の評価方法

原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

③外国投資信託証券の評価方法

原則として計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）で評価します。

④マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

⑤マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

- ・国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

- ・外国上場株式、外国上場投資信託受益証券（海外REITを含みます。）、外国上場投資証券（海外REITを含みます。）（上場には店頭登録を含みます。）

原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

- ・公社債等（仕組債を含みます。）

計算日（※）における次のa.からc.までに掲げるいずれかの価額で評価します。

- a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
- b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）
- c. 価格情報会社の提供する価額

※外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

- ・債券先物取引

原則として、金融商品取引所等が発表する計算日の清算値段（外国で取引されているものについては、計算日に知り得る直近の日の主たる金融商品取引所等が発表する清算値段又は最終相場）で評価します。

⑥外貨建資産等の円換算

外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

<基準価額の照会方法>

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ (<https://www.smtam.jp/>) でご覧いただけます。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

2015年6月16日(設定日)から2026年2月17日までとします。

ただし、下記「(5)その他 <投資信託契約の終了(償還)と手続き>」の事項に該当する場合は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

なお、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

(4)【計算期間】

原則として、毎年2月18日から翌年2月17日までとします。

ただし、第1計算期間は2015年6月16日から2016年2月17日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

<投資信託契約の終了(償還)と手続き>

(1)投資信託契約の終了(ファンドの繰上償還)

①委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了(繰上償還)させることができます。

- ・受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

②委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

③委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

④委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2)投資信託契約の終了(ファンドの繰上償還)に係る書面決議の手続き

委託会社は上記(1)①によりファンドの繰上償還を行おうとする場合、以下の手続きで行います。

- ①委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ④上記①から③までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記①から③までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

(1)投資信託約款の変更等

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託約款を変更すること又は受託会社を同一とする他のファンドとの併合を行うことができます。

- ・受益者の利益のため必要と認めるとき
- ・やむを得ない事情が発生したとき

委託会社は、投資信託約款の変更又はファンドの併合を行う場合は、あらかじめ、その旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続きに従います。

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

委託会社はファンドの約款変更のうち重大な内容の変更（以下「重大な約款変更」といいます。）又はファンドの併合について、以下の手続きで行います。

- ①委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。
- ⑤上記①から④までの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- ⑥当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファンドにお

いて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

<受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い>

- ①受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。
- ②委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

<運用報告書>

委託会社は、毎決算時及び償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。

<関係法人との契約の更改手続き>

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約
当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

<公告>

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

<混蔵寄託>

金融機関又は第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及び外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下同じ。）から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書又はコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

<投資信託財産の登記等及び記載等の留保等>

- ①信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。
- ②上記①ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。
- ③投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

4 【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

- ①受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。
- ②収益分配金は、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。
- ③上記②の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。
- ④上記②に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。
- ⑤受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(2) 償還金に対する請求権

- ①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。
- ②償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。
- ③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。
- ④受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3) 換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることにより換金する権利を有します。

詳細につきましては、上記「2 換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4) 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの投資信託財産に関する帳簿書類の閲覧又は謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

(1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和38年大蔵省令第59号)」並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2022年2月18日から2023年2月17日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2023年4月25日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 後藤知弘
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているサテライト投資戦略ファンド（株式型）の2022年2月18日から2023年2月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、サテライト投資戦略ファンド（株式型）の2023年2月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を

開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファン드는継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンズと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

-
- (注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

1 【財務諸表】

【サテライト投資戦略ファンド（株式型）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 (2022年2月17日現在)	第8期 (2023年2月17日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	205,442,561	272,623,265
投資信託受益証券	2,760,840,637	2,839,242,976
投資証券	415,624,310	516,765,394
親投資信託受益証券	6,414,137,884	5,361,287,130
流動資産合計	9,796,045,392	8,989,918,765
資産合計	9,796,045,392	8,989,918,765
負債の部		
流動負債		
未払解約金	32,754,135	-
未払受託者報酬	2,832,129	2,479,507
未払委託者報酬	80,999,053	70,914,039
未払利息	306	57
その他未払費用	283,159	247,890
流動負債合計	116,868,782	73,641,493
負債合計	116,868,782	73,641,493
純資産の部		
元本等		
元本	7,704,434,536	6,970,541,061
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,974,742,074	1,945,736,211
(分配準備積立金)	2,053,668,196	1,999,575,150
元本等合計	9,679,176,610	8,916,277,272
純資産合計	9,679,176,610	8,916,277,272
負債純資産合計	9,796,045,392	8,989,918,765

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期		第8期	
	自	2021年2月18日 至 2022年2月17日	自	2022年2月18日 至 2023年2月17日
営業収益				
受取配当金		5,289,458		4,857,638
受取利息		584		868
有価証券売買等損益		818,379,145		302,980,209
営業収益合計		823,669,187		307,838,715
営業費用				
支払利息		60,767		83,865
受託者報酬		5,804,648		5,034,596
委託者報酬		166,012,920		143,989,389
その他費用		580,352		503,329
営業費用合計		172,458,687		149,611,179
営業利益又は営業損失(△)		651,210,500		158,227,536
経常利益又は経常損失(△)		651,210,500		158,227,536
当期純利益又は当期純損失(△)		651,210,500		158,227,536
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額(△)		103,320,397		△997,589
期首剰余金又は期首欠損金(△)		1,793,743,704		1,974,742,074
剰余金増加額又は欠損金減少額		24,130,393		17,898,873
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		24,130,393		17,898,873
剰余金減少額又は欠損金増加額		391,022,126		206,129,861
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		391,022,126		206,129,861
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金(△)		1,974,742,074		1,945,736,211

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	第7期 (2022年2月17日現在)	第8期 (2023年2月17日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	7,704,434,536 口	6,970,541,061 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2563 円 (12,563 円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2791 円 (12,791 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第7期 自 2021年2月18日 至 2022年2月17日	第8期 自 2022年2月18日 至 2023年2月17日																																																												
<p>分配金の計算過程</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>85,352,496 円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>462,537,607 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>173,010,683 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,505,778,093 円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>2,226,678,879 円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>7,704,434,536 口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>2,890 円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>－円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>－円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	85,352,496 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	462,537,607 円	収益調整金額	C	173,010,683 円	分配準備積立金額	D	1,505,778,093 円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,226,678,879 円	当ファンドの期末残存口数	F	7,704,434,536 口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,890 円	1万口当たり分配金額	H	－円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円	<p>分配金の計算過程</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>52,207,361 円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>107,017,764 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>174,271,128 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,840,350,025 円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>2,173,846,278 円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>6,970,541,061 口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>3,118 円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>－円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>－円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	52,207,361 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	107,017,764 円	収益調整金額	C	174,271,128 円	分配準備積立金額	D	1,840,350,025 円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,173,846,278 円	当ファンドの期末残存口数	F	6,970,541,061 口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	3,118 円	1万口当たり分配金額	H	－円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	85,352,496 円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	462,537,607 円																																																											
収益調整金額	C	173,010,683 円																																																											
分配準備積立金額	D	1,505,778,093 円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,226,678,879 円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	7,704,434,536 口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,890 円																																																											
1万口当たり分配金額	H	－円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	52,207,361 円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	107,017,764 円																																																											
収益調整金額	C	174,271,128 円																																																											
分配準備積立金額	D	1,840,350,025 円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,173,846,278 円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	6,970,541,061 口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	3,118 円																																																											
1万口当たり分配金額	H	－円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円																																																											

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第8期 自 2022年2月18日 至 2023年2月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第8期 (2023年2月17日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第7期 自 2021年2月18日 至 2022年2月17日	第8期 自 2022年2月18日 至 2023年2月17日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	9,724,467,321 円	7,704,434,536 円
期中追加設定元本額	97,944,390 円	70,367,550 円
期中一部解約元本額	2,117,977,175 円	804,261,025 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第7期 (2022年2月17日現在)	第8期 (2023年2月17日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	62,228,481	93,193,633
投資証券	△30,109,108	△3,565,147
親投資信託受益証券	443,443,364	174,310,525

合計	475,562,737	263,939,011
----	-------------	-------------

(デリバティブ取引に関する注記)
該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	ノムラ F O F s 用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド (適格機関投資家専用)	359,689,621	330,914,451	
	国内株式アクティブバリューファンド (適格機関投資家専用)	414,348,535	518,764,365	
	FOFs 用国内株式エンハンス運用戦略ファンド (適格機関投資家専用)	154,585,704	264,728,018	
	Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	20,881,707	245,944,745	
	グローバル株式コンセントレイト・ファンド (適格機関投資家専用)	149,449,529	255,573,639	
	日本長期成長株集中投資ファンド (適格機関投資家専用)	114,869,956	249,095,499	
	ブランディワイン・グローバル株式ファンド (適格機関投資家専用)	218,945,757	261,924,809	
	ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンド S (適格機関投資家専用)	192,720,887	179,750,771	
	F O F s 用 M A N A H L ダイバーシファイドリンクファンド (適格機関投資家専用)	102,653,070	127,330,868	
	FOFs 用国内株式 EVI バリューファンド (適格機関投資家専用)	354,954,285	405,215,811	
投資信託受益証券合計		2,062,238,225.707	2,839,242,976	
投資証券	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	163,373,842	259,601,034	
	MA Hedge Fund Strategies Limited	25,593	257,164,360	
投資証券合計		188,966,842	516,765,394	
親投資信託受益証券	J-R E I T インデックス マザーファンド	247,976,186	504,284,371	
	グローバル R E I T インデックス マザーファンド	182,175,015	460,101,217	
	中小型株式 マザーファンド	25,721,477	124,962,651	
	国内株式インデックス マザーファンド	452,804,007	903,706,237	
	外国株式インデックス マザーファンド	313,818,952	1,402,519,660	
	ピクテ マルチストラテジー リンク マザーフ	303,829,513	306,533,595	

	ファンド			
	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	517,627,891	631,040,161	
	コモディティL Sアルファ・マザーファンド	283,606,497	355,869,432	
	日本株式E S Gセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	116,243,652	124,671,316	
	外国株式E S Gリーダーズインデックスマザーファンド	105,866,103	123,132,864	
	米国株式L Sマザーファンド	267,116,183	285,306,795	
	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	154,896,295	139,158,831	
	親投資信託受益証券合計	2,971,681,771	5,361,287,130	
	合計		8,717,295,500	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

中小型株式 マザーファンド

貸借対照表

	2023年2月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	910,058,848
株式	21,255,545,900
未収入金	122,237,587
未収配当金	58,516,050
流動資産合計	22,346,358,385
資産合計	22,346,358,385
負債の部	
流動負債	
未払金	125,996,635
未払利息	192

流動負債合計	125,996,827
負債合計	125,996,827
純資産の部	
元本等	
元本	4,573,695,116
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	17,646,666,442
元本等合計	22,220,361,558
純資産合計	22,220,361,558
負債純資産合計	22,346,358,385

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年2月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年2月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	4,573,695,116口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 4.8583円 (1万口当たり純資産額) (48,583円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年2月17日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理(流動性リスク管理等を含む)と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年2月17日現在
--	--------------

1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年2月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年2月18日
期首元本額	5,936,933,069円
期中追加設定元本額	571,767,493円
期中一部解約元本額	1,935,005,446円
期末元本額	4,573,695,116円
期末元本額の内訳	
中小型株式オープン	2,834,330,177円
中小型株式オープン (SMA専用)	68,172,681円
国内株式SMTBセレクション (SMA専用)	1,645,470,781円
サテライト投資戦略ファンド (株式型)	25,721,477円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年2月17日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		1,107,805,108
合計		1,107,805,108

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「中小型株式 マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表
(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
日揮ホールディングス	100,000	1,749.00	174,900,000	
寿スピリッツ	58,000	8,610.00	499,380,000	
セーレン	154,000	2,508.00	386,232,000	
KHネオケム	124,500	2,594.00	322,953,000	
トリケミカル研究所	195,000	2,319.00	452,205,000	
ミルボン	55,000	5,740.00	315,700,000	
OATアグリオ	96,400	1,436.00	138,430,400	
エフピコ	70,000	3,500.00	245,000,000	
ニフコ	126,000	3,490.00	439,740,000	
ロート製薬	166,000	2,624.00	435,584,000	
ペプチドリーム	160,000	1,887.00	301,920,000	
MARUWA	35,000	17,530.00	613,550,000	
横河ブリッジホールディングス	120,000	2,017.00	242,040,000	
三益半導体工業	127,400	2,531.00	322,449,400	
オプトラン	8,000	2,041.00	16,328,000	
技研製作所	9,000	2,796.00	25,164,000	
ローツェ	56,000	10,210.00	571,760,000	
イビデン	45,000	4,565.00	205,425,000	
富士電機	30,000	5,230.00	156,900,000	
安川電機	50,000	5,130.00	256,500,000	
オキサイド	26,000	8,390.00	218,140,000	
レーザーテック	11,000	22,285.00	245,135,000	
日本セラミック	178,000	2,740.00	487,720,000	
大真空	230,000	751.00	172,730,000	
ナカニシ	159,000	2,823.00	448,857,000	
ブシロード	360,000	736.00	264,960,000	
前田工織	84,900	3,245.00	275,500,500	
SHOEI	73,000	5,080.00	370,840,000	
アシックス	40,000	3,275.00	131,000,000	
メタウォーター	77,000	1,640.00	126,280,000	
手間いらず	57,600	4,850.00	279,360,000	
ネクソン	45,000	3,075.00	138,375,000	

SHIFT	12,500	22,480.00	281,000,000	
GMOペイメントゲートウェイ	12,000	11,480.00	137,760,000	
インターネットイニシアティブ	110,000	2,650.00	291,500,000	
カナミックネットワーク	205,000	518.00	106,190,000	
チェンジ	92,000	2,604.00	239,568,000	
ビジョナル	52,000	8,940.00	464,880,000	
サスメド	78,000	1,314.00	102,492,000	
シンプレクス・ホールディングス	160,000	2,311.00	369,760,000	
S a n s a n	150,000	1,540.00	231,000,000	
ギフトィ	95,000	2,727.00	259,065,000	
JMDC	45,000	4,360.00	196,200,000	
ANYCOLOR	43,000	4,775.00	205,325,000	
ネットワンシステムズ	140,000	3,305.00	462,700,000	
ビジョン	220,000	1,532.00	337,040,000	
東宝	113,000	4,770.00	539,010,000	
カブコン	148,800	4,540.00	675,552,000	
神戸物産	135,000	3,600.00	486,000,000	
アズワン	60,000	5,720.00	343,200,000	
阪和興業	56,000	3,960.00	221,760,000	
物語コーポレーション	80,000	7,070.00	565,600,000	
ネクステージ	110,000	3,160.00	347,600,000	
ワークマン	80,000	5,490.00	439,200,000	
薬王堂ホールディングス	76,000	2,435.00	185,060,000	
京都銀行	15,000	6,370.00	95,550,000	
ライフネット生命保険	100,000	1,256.00	125,600,000	
FPパートナー	27,000	5,530.00	149,310,000	
アニコム ホールディングス	346,000	537.00	185,802,000	
イー・ギャランティ	188,000	2,220.00	417,360,000	
SREホールディングス	80,000	3,440.00	275,200,000	
ティーケーピー	90,000	2,994.00	269,460,000	
エス・エム・エス	110,000	3,340.00	367,400,000	
エスプール	184,400	679.00	125,207,600	
サイバーエージェント	340,000	1,210.00	411,400,000	
弁護士ドットコム	70,000	2,776.00	194,320,000	
Keeper 技研	70,000	3,505.00	245,350,000	
ジャパンマテリアル	231,000	2,355.00	544,005,000	

エラン	86,000	1,066.00	91,676,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	190,000	2,010.00	381,900,000	
マネジメントソリューションズ	60,000	3,625.00	217,500,000	
LITALICO	45,000	2,569.00	115,605,000	
ダイセキ	68,000	4,035.00	274,380,000	
合 計	7,700,500		21,255,545,900	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年2月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,602,512,384
株式	514,788,872,960
派生商品評価勘定	37,531,950
未収入金	22,338,810
未収配当金	917,447,929
差入委託証拠金	61,860,800
流動資産合計	517,430,564,833
資産合計	517,430,564,833
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,563,900
前受金	35,993,900
未払解約金	584,214,782
未払利息	339
流動負債合計	621,772,921
負債合計	621,772,921
純資産の部	
元本等	

元本	258,952,777,044
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	257,856,014,868
元本等合計	516,808,791,912
純資産合計	516,808,791,912
負債純資産合計	517,430,564,833

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年2月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年2月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	258,952,777,044 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.9958 円 (1万口当たり純資産額) (19,958 円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年2月17日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。
-------------------	--

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年2月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年2月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年2月18日
期首元本額	253,376,742,235円
期中追加設定元本額	30,184,930,533円
期中一部解約元本額	24,608,895,724円
期末元本額	258,952,777,044円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	374,442,075円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	4,086,812,568円
SBI資産設計オープン(分配型)	14,322,201円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,892,295,585円
世界経済インデックスファンド	4,323,893,717円
日本株式インデックス・オープン	3,205,930,183円
DCマイセレクション25	6,162,013,481円
DCマイセレクション50	18,915,264,187円

DCマイセレクション75	19,326,549,259円
DC日本株式インデックス・オープン	6,098,473,487円
DCマイセレクションS25	3,280,358,189円
DCマイセレクションS50	9,586,643,095円
DCマイセレクションS75	7,541,282,270円
DC日本株式インデックス・オープンS	8,608,444,536円
DCターゲット・イヤーフンド2025	160,209,733円
DCターゲット・イヤーフンド2035	694,509,198円
DCターゲット・イヤーフンド2045	522,784,770円
DC世界経済インデックスファンド	3,562,220,756円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,306,082,387円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	6,110,166円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	16,503,636円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	15,793,533円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	161,496,034円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,280,372円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	24,344,753円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	91,841,307円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	19,386,585円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	52,587,516円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	742,504,022円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	401,051,567円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,605,472,042円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	37,833,319円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	15,957,958円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	431,883,127円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	243,515,549円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	317,019,452円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	33,926,824円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	537,417,871円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,122,495,375円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,994,182,968円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,723,583,109円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,756,334,500円
分散投資コア戦略ファンドA	1,561,018,872円
分散投資コア戦略ファンドS	6,232,800,431円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	511,419,523円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	382,821,962円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,570,442,451円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	207,191,240円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,638,381円
SMTインデックスバランス・オープン	52,056,819円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	28,478,688,332円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	452,804,007円
SMT世界経済インデックス・オープン	44,834,437円
SMT世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	177,501,946円
SMT世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	30,752,427円
SMT8資産インデックスバランス・オープン	10,640,728円
グローバル経済コア	209,408,800円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	31,296,385円
MySMTTOPIXインデックス(ノーロード)	412,156,790円
DCターゲット・イヤーフンド2055	26,481,583円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,247,297,494円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	251,447,408円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	22,217,682円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	19,650,603円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	8,556,085円

DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	12,177,260円
10資産分散投資ファンド	94,420,608円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	44,271,387,994円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	749,005,525円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	293,403,708円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	21,341,818円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	566,472,752円
SMTAM日本株式インデックスファンドVLP（適格機関投資家専用）	44,747,699,053円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	16,376,084円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	213,314,594円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年2月17日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		18,120,040,364
合計		18,120,040,364

（注）当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「国内株式インデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年2月17日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,932,621,100	—	1,968,615,000	35,993,900
	合計	1,932,621,100	—	1,968,615,000	35,993,900

（注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	9,500	3,625.00	34,437,500	
ニッセイ	252,000	537.00	135,324,000	
マルハニチロ	37,400	2,418.00	90,433,200	
雪国まいたけ	21,500	1,016.00	21,844,000	

カネコ種苗	8,300	1,642.00	13,628,600	
サカタのタネ	28,700	3,990.00	114,513,000	
ホクト	22,400	1,872.00	41,932,800	
ホクリヨウ	3,200	824.00	2,636,800	
住石ホールディングス	34,800	377.00	13,119,600	
日鉄鉱業	10,100	3,530.00	35,653,000	
三井松島ホールディングス	11,400	3,820.00	43,548,000	
I N P E X	932,000	1,438.00	1,340,216,000	
石油資源開発	29,200	4,865.00	142,058,000	
K&Oエナジーグループ	11,400	2,174.00	24,783,600	
ショーボンドホールディングス	34,300	5,220.00	179,046,000	
ミライト・ワン	87,400	1,489.00	130,138,600	
タマホーム	17,800	3,210.00	57,138,000	
サンヨーホームズ	2,700	744.00	2,008,800	
日本アクア	9,300	976.00	9,076,800	
ファーストコーポレーション	5,800	737.00	4,274,600	
ベストセラ	4,800	911.00	4,372,800	
R o b o t H o m e	42,900	195.00	8,365,500	
キャンディル	3,500	503.00	1,760,500	
ダイセキ環境ソリューション	4,500	964.00	4,338,000	
第一カッター興業	6,500	1,085.00	7,052,500	
安藤・間	146,000	871.00	127,166,000	
東急建設	71,800	663.00	47,603,400	
コムシスホールディングス	85,300	2,478.00	211,373,400	
ビーアールホールディングス	40,000	340.00	13,600,000	
高松コンストラクショングループ	16,400	1,971.00	32,324,400	
東建コーポレーション	8,100	7,530.00	60,993,000	
ソネック	2,400	951.00	2,282,400	
ヤマウラ	12,800	1,037.00	13,273,600	
オリエンタル白石	90,600	309.00	27,995,400	
大成建設	175,500	4,330.00	759,915,000	
大林組	630,400	969.00	610,857,600	
清水建設	530,000	724.00	383,720,000	
飛鳥建設	19,500	1,056.00	20,592,000	
長谷工コーポレーション	182,000	1,518.00	276,276,000	
松井建設	16,400	624.00	10,233,600	

錢高組	2,000	2,954.00	5,908,000
鹿島建設	390,900	1,596.00	623,876,400
不動テトラ	12,200	1,624.00	19,812,800
大末建設	5,700	1,181.00	6,731,700
鉄建建設	12,600	1,777.00	22,390,200
西松建設	29,900	3,500.00	104,650,000
三井住友建設	142,100	417.00	59,255,700
大豊建設	7,300	3,835.00	27,995,500
佐田建設	10,000	514.00	5,140,000
ナカノフドー建設	11,100	325.00	3,607,500
奥村組	28,600	3,200.00	91,520,000
東鉄工業	24,300	2,754.00	66,922,200
イチケン	3,500	1,805.00	6,317,500
富士ピー・エス	7,000	452.00	3,164,000
浅沼組	14,100	3,225.00	45,472,500
戸田建設	216,900	707.00	153,348,300
熊谷組	30,500	2,715.00	82,807,500
北野建設	2,900	2,885.00	8,366,500
植木組	4,400	1,370.00	6,028,000
矢作建設工業	24,000	816.00	19,584,000
ピーエス三菱	22,300	638.00	14,227,400
日本ハウスホールディングス	35,000	394.00	13,790,000
新日本建設	24,700	870.00	21,489,000
東亜道路工業	3,500	6,250.00	21,875,000
日本道路	3,500	6,750.00	23,625,000
東亜建設工業	15,100	2,588.00	39,078,800
日本国土開発	52,800	549.00	28,987,200
若築建設	7,800	3,035.00	23,673,000
東洋建設	57,100	892.00	50,933,200
五洋建設	249,900	648.00	161,935,200
世紀東急工業	23,200	785.00	18,212,000
福田組	6,600	4,425.00	29,205,000
住友林業	135,200	2,624.00	354,764,800
日本基礎技術	9,500	545.00	5,177,500
巴コーポレーション	17,500	407.00	7,122,500
大和ハウス工業	492,600	3,109.00	1,531,493,400

ライト工業	33,600	1,955.00	65,688,000
積水ハウス	552,200	2,519.50	1,391,267,900
日特建設	16,800	926.00	15,556,800
北陸電気工事	12,100	744.00	9,002,400
ユアテック	38,800	744.00	28,867,200
日本リーテック	11,600	844.00	9,790,400
四電工	7,400	1,835.00	13,579,000
中電工	27,400	2,117.00	58,005,800
関電工	96,600	867.00	83,752,200
きんでん	124,100	1,487.00	184,536,700
東京エネシス	17,500	904.00	15,820,000
トーエネック	5,800	3,410.00	19,778,000
住友電設	16,800	2,366.00	39,748,800
日本電設工業	29,000	1,496.00	43,384,000
エクシオグループ	81,200	2,362.00	191,794,400
新日本空調	9,800	1,886.00	18,482,800
九電工	42,900	3,430.00	147,147,000
三機工業	39,100	1,483.00	57,985,300
日揮ホールディングス	174,400	1,749.00	305,025,600
中外炉工業	5,800	1,792.00	10,393,600
ヤマト	13,000	801.00	10,413,000
太平電業	10,900	3,710.00	40,439,000
高砂熱学工業	42,500	1,992.00	84,660,000
三晃金属工業	1,900	3,800.00	7,220,000
朝日工業社	7,300	2,105.00	15,366,500
明星工業	30,300	776.00	23,512,800
大気社	21,200	3,520.00	74,624,000
ダイダン	11,600	2,220.00	25,752,000
日比谷総合設備	15,100	1,992.00	30,079,200
フィル・カンパニー	3,100	1,057.00	3,276,700
テスホールディングス	19,000	1,065.00	20,235,000
インフロニア・ホールディングス	184,700	1,036.00	191,349,200
東洋エンジニアリング	23,300	588.00	13,700,400
レイズネクスト	25,500	1,343.00	34,246,500
ニッポン	47,700	1,595.00	76,081,500
日清製粉グループ本社	163,700	1,554.00	254,389,800

日東富士製粉	3,200	4,410.00	14,112,000	
昭和産業	15,400	2,486.00	38,284,400	
鳥越製粉	12,600	586.00	7,383,600	
中部飼料	24,500	1,028.00	25,186,000	
フィード・ワン	25,900	679.00	17,586,100	
東洋精糖	2,900	882.00	2,557,800	
日本甜菜製糖	10,300	1,639.00	16,881,700	
DM三井製糖ホールディングス	17,600	2,036.00	35,833,600	
塩水港精糖	18,800	197.00	3,703,600	
ウェルネオシュガー	9,100	1,659.00	15,096,900	
森永製菓	32,800	3,850.00	126,280,000	
中村屋	4,400	3,045.00	13,398,000	
江崎グリコ	50,600	3,485.00	176,341,000	
名糖産業	7,000	1,686.00	11,802,000	
井村屋グループ	9,700	2,213.00	21,466,100	
不二家	12,100	2,491.00	30,141,100	
山崎製パン	118,400	1,571.00	186,006,400	
第一屋製パン	3,000	374.00	1,122,000	
モロゾフ	5,700	3,400.00	19,380,000	
亀田製菓	11,300	4,330.00	48,929,000	
寿スピリッツ	18,800	8,610.00	161,868,000	
カルビー	81,000	2,885.00	233,685,000	
森永乳業	32,200	4,725.00	152,145,000	
六甲バター	13,000	1,333.00	17,329,000	
ヤクルト本社	126,500	9,090.00	1,149,885,000	
明治ホールディングス	109,700	6,400.00	702,080,000	
雪印メグミルク	42,800	1,758.00	75,242,400	
プリマハム	23,800	2,146.00	51,074,800	
日本ハム	69,200	3,710.00	256,732,000	
林兼産業	4,800	458.00	2,198,400	
丸大食品	17,800	1,478.00	26,308,400	
S Foods	19,500	2,773.00	54,073,500	
柿安本店	6,900	2,036.00	14,048,400	
伊藤ハム米久ホールディングス	137,600	717.00	98,659,200	
サッポロホールディングス	58,300	3,080.00	179,564,000	
アサヒグループホールディングス	408,900	4,668.00	1,908,745,200	

キリンホールディングス	798,600	1,996.50	1,594,404,900	
宝ホールディングス	120,800	1,065.00	128,652,000	
オエノンホールディングス	52,900	264.00	13,965,600	
養命酒製造	5,800	1,825.00	10,585,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	138,600	1,399.00	193,901,400	
サントリー食品インターナショナル	124,600	4,680.00	583,128,000	
ダイドーグループホールディングス	10,000	4,790.00	47,900,000	
伊藤園	60,000	4,470.00	268,200,000	
キーコーヒー	19,800	2,072.00	41,025,600	
ユニカフェ	5,200	888.00	4,617,600	
ジャパンフーズ	2,500	1,097.00	2,742,500	
日清オイリオグループ	24,900	3,290.00	81,921,000	
不二製油グループ本社	41,200	1,982.00	81,658,400	
かどや製油	1,900	3,525.00	6,697,500	
J-オイルミルズ	18,000	1,552.00	27,936,000	
キッコーマン	117,300	6,520.00	764,796,000	
味の素	433,100	4,038.00	1,748,857,800	
ブルドックソース	7,000	1,891.00	13,237,000	
キュービー	95,100	2,250.00	213,975,000	
ハウス食品グループ本社	54,200	2,691.00	145,852,200	
カゴメ	82,500	3,000.00	247,500,000	
焼津水産化学工業	7,000	964.00	6,748,000	
アリアケジャパン	15,400	4,800.00	73,920,000	
ピエトロ	2,300	1,821.00	4,188,300	
エバラ食品工業	4,700	3,025.00	14,217,500	
やまみ	1,500	1,425.00	2,137,500	
ニチレイ	81,100	2,678.00	217,185,800	
東洋水産	89,400	5,560.00	497,064,000	
イトアンドホールディングス	7,500	2,298.00	17,235,000	
大冷	1,900	1,890.00	3,591,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	11,200	976.00	10,931,200	
日清食品ホールディングス	62,200	11,280.00	701,616,000	
永谷園ホールディングス	8,700	2,085.00	18,139,500	
一正蒲鉾	6,700	703.00	4,710,100	
フジッコ	18,200	1,864.00	33,924,800	

ロック・フィールド	21,600	1,568.00	33,868,800	
日本たばこ産業	1,165,000	2,771.00	3,228,215,000	
ケンコーマヨネーズ	12,200	1,277.00	15,579,400	
わらべや日洋ホールディングス	13,000	1,875.00	24,375,000	
なとり	11,100	2,047.00	22,721,700	
イフジ産業	2,700	914.00	2,467,800	
ファーマフーズ	27,400	1,455.00	39,867,000	
ユウグレナ	114,000	955.00	108,870,000	
紀文食品	13,800	955.00	13,179,000	
ピクルスホールディングス	10,400	1,236.00	12,854,400	
ミヨシ油脂	5,500	954.00	5,247,000	
理研ビタミン	15,300	2,022.00	30,936,600	
片倉工業	17,000	1,696.00	28,832,000	
グンゼ	13,700	4,310.00	59,047,000	
東洋紡	78,500	1,024.00	80,384,000	
ユニチカ	57,400	227.00	13,029,800	
富士紡ホールディングス	7,300	3,110.00	22,703,000	
倉敷紡績	13,800	2,459.00	33,934,200	
シキボウ	8,900	998.00	8,882,200	
日本毛織	48,200	945.00	45,549,000	
トーア紡コーポレーション	6,300	353.00	2,223,900	
帝国繊維	20,800	1,577.00	32,801,600	
帝人	173,500	1,423.00	246,890,500	
東レ	1,207,200	788.00	951,273,600	
住江織物	3,300	1,898.00	6,263,400	
日本フェルト	10,400	409.00	4,253,600	
イチカワ	2,500	1,338.00	3,345,000	
日東製網	1,700	1,518.00	2,580,600	
アツギ	9,900	386.00	3,821,400	
ダイニック	4,100	758.00	3,107,800	
セーレン	35,100	2,508.00	88,030,800	
ソトー	5,300	796.00	4,218,800	
東海染工	1,800	1,074.00	1,933,200	
小松マテーレ	26,400	713.00	18,823,200	
ワコールホールディングス	34,800	2,324.00	80,875,200	
ホギメディカル	24,200	3,230.00	78,166,000	

T S I ホールディングス	64,900	559.00	36,279,100	
マツオカコーポレーション	4,500	1,364.00	6,138,000	
ワールド	23,300	1,332.00	31,035,600	
三陽商会	6,100	1,433.00	8,741,300	
ナイガイ	6,100	258.00	1,573,800	
オンワードホールディングス	117,500	338.00	39,715,000	
ルックホールディングス	4,700	2,135.00	10,034,500	
ゴールドウイン	31,900	11,040.00	352,176,000	
デサント	31,100	3,905.00	121,445,500	
キング	7,400	509.00	3,766,600	
ヤマトインターナショナル	13,500	248.00	3,348,000	
特種東海製紙	8,000	2,883.00	23,064,000	
王子ホールディングス	750,000	527.00	395,250,000	
日本製紙	93,800	965.00	90,517,000	
三菱製紙	19,300	282.00	5,442,600	
北越コーポレーション	113,800	761.00	86,601,800	
中越パルプ工業	6,500	966.00	6,279,000	
巴川製紙所	5,000	662.00	3,310,000	
大王製紙	79,500	1,029.00	81,805,500	
阿波製紙	3,800	750.00	2,850,000	
レンゴー	164,000	891.00	146,124,000	
トーモク	10,400	1,518.00	15,787,200	
ザ・パック	13,400	2,839.00	38,042,600	
北の達人コーポレーション	75,900	338.00	25,654,200	
クラレ	286,200	1,184.00	338,860,800	
旭化成	1,124,300	938.20	1,054,818,260	
共和レザー	9,200	506.00	4,655,200	
レゾナック・ホールディングス	174,000	2,296.00	399,504,000	
住友化学	1,335,600	473.00	631,738,800	
住友精化	7,500	4,160.00	31,200,000	
日産化学	85,500	5,860.00	501,030,000	
ラサ工業	6,900	2,105.00	14,524,500	
クレハ	15,400	8,210.00	126,434,000	
多木化学	7,000	4,345.00	30,415,000	
テイカ	12,100	1,165.00	14,096,500	
石原産業	32,600	1,052.00	34,295,200	

片倉コープアグリ	3,300	1,860.00	6,138,000	
日本曹達	19,300	4,380.00	84,534,000	
東ソー	240,300	1,748.00	420,044,400	
トクヤマ	58,100	2,059.00	119,627,900	
セントラル硝子	28,900	2,814.00	81,324,600	
東亜合成	92,600	1,186.00	109,823,600	
大阪ソーダ	10,800	4,145.00	44,766,000	
関東電化工業	34,800	1,009.00	35,113,200	
デンカ	65,500	2,904.00	190,212,000	
信越化学工業	303,800	19,275.00	5,855,745,000	
日本カーバイド工業	6,100	1,297.00	7,911,700	
堺化学工業	13,700	1,784.00	24,440,800	
第一稀元素化学工業	16,400	1,023.00	16,777,200	
エア・ウォーター	169,900	1,599.00	271,670,100	
日本酸素ホールディングス	174,700	2,367.00	413,514,900	
日本化学工業	6,000	1,962.00	11,772,000	
東邦アセチレン	3,400	1,244.00	4,229,600	
日本パーカライジング	89,100	931.00	82,952,100	
高圧ガス工業	26,100	654.00	17,069,400	
チタン工業	2,000	1,448.00	2,896,000	
四国化成ホールディングス	21,400	1,266.00	27,092,400	
戸田工業	4,100	2,478.00	10,159,800	
ステラ ケミファ	10,700	2,505.00	26,803,500	
保土谷化学工業	5,100	3,065.00	15,631,500	
日本触媒	27,400	5,650.00	154,810,000	
大日精化工業	12,500	1,750.00	21,875,000	
カネカ	41,100	3,400.00	139,740,000	
三菱瓦斯化学	134,400	1,916.00	257,510,400	
三井化学	151,400	3,190.00	482,966,000	
J S R	168,100	3,130.00	526,153,000	
東京応化工業	31,500	7,230.00	227,745,000	
大阪有機化学工業	13,600	2,024.00	27,526,400	
三菱ケミカルグループ	1,214,900	805.80	978,966,420	
KHネオケム	30,000	2,594.00	77,820,000	
ダイセル	264,700	930.00	246,171,000	
住友ベークライト	26,700	4,475.00	119,482,500	

積水化学工業	368,200	1,801.00	663,128,200	
日本ゼオン	108,000	1,284.00	138,672,000	
アイカ工業	45,400	3,005.00	136,427,000	
UBE	92,800	2,049.00	190,147,200	
積水樹脂	26,200	1,930.00	50,566,000	
タキロンシーアイ	39,300	495.00	19,453,500	
旭有機材	12,000	2,803.00	33,636,000	
ニチバン	11,200	1,798.00	20,137,600	
リケンテクノス	38,800	544.00	21,107,200	
大倉工業	8,300	1,882.00	15,620,600	
積水化成工業	25,300	388.00	9,816,400	
群栄化学工業	4,200	2,486.00	10,441,200	
タイガースポリマー	7,300	416.00	3,036,800	
ミライアル	4,900	1,544.00	7,565,600	
ダイキアクシス	5,900	686.00	4,047,400	
ダイキョーニシカワ	39,700	625.00	24,812,500	
竹本容器	5,400	833.00	4,498,200	
森六ホールディングス	9,100	1,808.00	16,452,800	
恵和	11,600	1,549.00	17,968,400	
日本化薬	137,500	1,180.00	162,250,000	
カーリットホールディングス	16,200	732.00	11,858,400	
日本精化	10,200	2,434.00	24,826,800	
扶桑化学工業	16,700	3,665.00	61,205,500	
トリケミカル研究所	24,000	2,319.00	55,656,000	
ADEKA	62,800	2,103.00	132,068,400	
日油	55,700	5,950.00	331,415,000	
新日本理化	22,100	215.00	4,751,500	
ハリマ化成グループ	11,200	871.00	9,755,200	
花王	438,400	5,080.00	2,227,072,000	
第一工業製薬	6,500	1,945.00	12,642,500	
石原ケミカル	8,200	1,298.00	10,643,600	
日華化学	6,400	829.00	5,305,600	
ニイタカ	2,900	2,038.00	5,910,200	
三洋化成工業	11,100	4,210.00	46,731,000	
有機合成薬品工業	11,800	290.00	3,422,000	
大日本塗料	22,000	822.00	18,084,000	

日本ペイントホールディングス	796,700	1,254.00	999,061,800	
関西ペイント	164,900	1,839.00	303,251,100	
神東塗料	13,300	124.00	1,649,200	
中国塗料	32,300	1,092.00	35,271,600	
日本特殊塗料	10,200	915.00	9,333,000	
藤倉化成	24,200	435.00	10,527,000	
太陽ホールディングス	27,400	2,387.00	65,403,800	
D I C	70,400	2,374.00	167,129,600	
サカタインクス	40,100	1,014.00	40,661,400	
東洋インキS Cホールディングス	35,300	1,866.00	65,869,800	
T & K TOKA	16,000	1,277.00	20,432,000	
富士フイルムホールディングス	345,900	6,399.00	2,213,414,100	
資生堂	376,400	6,159.00	2,318,247,600	
ライオン	216,300	1,463.00	316,446,900	
高砂香料工業	12,200	2,487.00	30,341,400	
マンダム	38,900	1,431.00	55,665,900	
ミルボン	26,700	5,740.00	153,258,000	
ファンケル	78,900	2,524.00	199,143,600	
コーセー	36,700	15,310.00	561,877,000	
コタ	15,100	1,695.00	25,594,500	
シーボン	2,100	1,608.00	3,376,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	92,400	1,757.00	162,346,800	
ノエビアホールディングス	16,100	5,540.00	89,194,000	
アジュバンホールディングス	3,900	1,005.00	3,919,500	
新日本製薬	10,300	1,417.00	14,595,100	
エステー	13,900	1,545.00	21,475,500	
アグロ カネショウ	7,200	1,520.00	10,944,000	
コニシ	30,100	1,785.00	53,728,500	
長谷川香料	37,300	2,943.00	109,773,900	
星光PMC	8,200	534.00	4,378,800	
小林製薬	52,500	8,300.00	435,750,000	
荒川化学工業	15,300	982.00	15,024,600	
メック	14,800	2,240.00	33,152,000	
日本高純度化学	4,500	2,427.00	10,921,500	
タカラバイオ	48,600	1,761.00	85,584,600	
J C U	20,400	3,065.00	62,526,000	

新田ゼラチン	9,900	807.00	7,989,300	
OATアグリオ	6,600	1,436.00	9,477,600	
デクセリアルズ	52,100	2,717.00	141,555,700	
アース製薬	16,300	4,800.00	78,240,000	
北興化学工業	18,100	818.00	14,805,800	
大成ラミック	5,700	2,880.00	16,416,000	
クミアイ化学工業	71,600	857.00	61,361,200	
日本農薬	33,100	690.00	22,839,000	
アキレス	11,700	1,248.00	14,601,600	
有沢製作所	29,500	1,400.00	41,300,000	
日東電工	130,900	8,390.00	1,098,251,000	
レック	25,700	947.00	24,337,900	
三光合成	24,800	553.00	13,714,400	
きもと	23,600	198.00	4,672,800	
藤森工業	14,200	3,085.00	43,807,000	
前澤化成工業	11,600	1,380.00	16,008,000	
未来工業	6,500	1,498.00	9,737,000	
ウェーブロックホールディングス	4,800	608.00	2,918,400	
JSP	12,700	1,577.00	20,027,900	
エフピコ	34,100	3,500.00	119,350,000	
天馬	15,300	2,264.00	34,639,200	
信越ポリマー	33,300	1,353.00	45,054,900	
東リ	35,900	252.00	9,046,800	
ニフコ	65,000	3,490.00	226,850,000	
バルカー	15,100	3,185.00	48,093,500	
ユニ・チャーム	375,600	5,050.00	1,896,780,000	
ショーエイコーポレーション	4,600	564.00	2,594,400	
協和キリン	217,800	2,940.00	640,332,000	
武田薬品工業	1,595,300	4,182.00	6,671,544,600	
アステラス製薬	1,727,600	1,927.00	3,329,085,200	
住友ファーマ	133,800	852.00	113,997,600	
塩野義製薬	230,400	6,147.00	1,416,268,800	
わかもと製薬	15,500	225.00	3,487,500	
日本新薬	42,500	6,260.00	266,050,000	
中外製薬	564,300	3,556.00	2,006,650,800	
科研製薬	30,900	3,625.00	112,012,500	

エーザイ	219,300	7,625.00	1,672,162,500	
ロート製薬	174,700	2,624.00	458,412,800	
小野薬品工業	347,800	2,847.00	990,186,600	
久光製薬	40,100	3,885.00	155,788,500	
持田製薬	21,600	3,405.00	73,548,000	
参天製薬	339,300	995.00	337,603,500	
扶桑薬品工業	5,800	1,970.00	11,426,000	
日本ケミファ	1,700	1,723.00	2,929,100	
ツムラ	56,800	2,615.00	148,532,000	
キッセイ薬品工業	27,900	2,526.00	70,475,400	
生化学工業	34,500	809.00	27,910,500	
栄研化学	29,300	1,563.00	45,795,900	
鳥居薬品	9,700	3,230.00	31,331,000	
JCRファーマ	61,100	1,557.00	95,132,700	
東和薬品	27,800	1,902.00	52,875,600	
富士製薬工業	11,700	1,042.00	12,191,400	
ゼリア新薬工業	25,000	2,183.00	54,575,000	
第一三共	1,570,400	4,300.00	6,752,720,000	
キョーリン製薬ホールディングス	39,100	1,684.00	65,844,400	
大幸薬品	32,900	413.00	13,587,700	
ダイト	13,600	2,455.00	33,388,000	
大塚ホールディングス	412,500	4,175.00	1,722,187,500	
大正製薬ホールディングス	40,100	5,390.00	216,139,000	
ペプチドリーム	87,400	1,887.00	164,923,800	
あすか製薬ホールディングス	18,600	1,165.00	21,669,000	
サワイグループホールディングス	41,200	3,785.00	155,942,000	
日本コークス工業	162,600	86.00	13,983,600	
ニチレキ	21,300	1,373.00	29,244,900	
ユシロ化学工業	9,300	826.00	7,681,800	
ビーピー・カストロール	6,200	896.00	5,555,200	
富士石油	36,800	253.00	9,310,400	
MORESCO	5,200	1,211.00	6,297,200	
出光興産	200,200	3,095.00	619,619,000	
ENEOSホールディングス	3,256,800	459.40	1,496,173,920	
コスモエネルギーホールディングス	71,300	3,830.00	273,079,000	
横浜ゴム	102,600	2,215.00	227,259,000	

TOYO TIRE	103,600	1,569.00	162,548,400	
ブリヂストン	575,600	5,148.00	2,963,188,800	
住友ゴム工業	176,800	1,219.00	215,519,200	
藤倉コンポジット	11,300	956.00	10,802,800	
オカモト	10,000	3,895.00	38,950,000	
フコク	9,500	1,050.00	9,975,000	
ニッタ	18,300	2,913.00	53,307,900	
住友理工	35,000	713.00	24,955,000	
三ツ星ベルト	26,300	3,835.00	100,860,500	
バンドー化学	28,600	1,013.00	28,971,800	
日東紡績	21,500	2,100.00	45,150,000	
A G C	183,500	4,920.00	902,820,000	
日本板硝子	91,900	678.00	62,308,200	
石塚硝子	2,600	1,445.00	3,757,000	
日本山村硝子	6,200	566.00	3,509,200	
日本電気硝子	73,600	2,455.00	180,688,000	
オハラ	8,600	1,182.00	10,165,200	
住友大阪セメント	25,400	3,760.00	95,504,000	
太平洋セメント	114,800	2,408.00	276,438,400	
日本ヒューム	15,900	658.00	10,462,200	
日本コンクリート工業	35,400	229.00	8,106,600	
三谷セキサン	7,600	4,310.00	32,756,000	
アジアパイルホールディングス	28,300	633.00	17,913,900	
東海カーボン	151,300	1,291.00	195,328,300	
日本カーボン	10,400	4,135.00	43,004,000	
東洋炭素	11,300	4,195.00	47,403,500	
ノリタケカンパニーリミテド	9,000	4,390.00	39,510,000	
TOTO	119,000	4,560.00	542,640,000	
日本碍子	213,300	1,787.00	381,167,100	
日本特殊陶業	137,300	2,733.00	375,240,900	
MARUWA	6,700	17,530.00	117,451,000	
品川リフラクトリーズ	5,100	4,275.00	21,802,500	
黒崎播磨	3,700	6,320.00	23,384,000	
ヨータイ	12,100	1,497.00	18,113,700	
東京窯業	15,000	303.00	4,545,000	
ニッカトー	7,400	555.00	4,107,000	

フジミインコーポレーテッド	14,400	6,500.00	93,600,000	
クニミネ工業	4,800	871.00	4,180,800	
エーアンドエーマテリアル	3,000	912.00	2,736,000	
ニチアス	45,600	2,573.00	117,328,800	
ニチハ	22,600	2,641.00	59,686,600	
日本製鉄	830,400	3,050.00	2,532,720,000	
神戸製鋼所	373,100	877.00	327,208,700	
中山製鋼所	38,200	1,058.00	40,415,600	
合同製鐵	9,200	3,400.00	31,280,000	
J F E ホールディングス	495,600	1,705.00	844,998,000	
東京製鐵	52,200	1,499.00	78,247,800	
共英製鋼	21,200	1,559.00	33,050,800	
大和工業	30,600	5,270.00	161,262,000	
東京鐵鋼	8,900	1,762.00	15,681,800	
大阪製鐵	8,600	1,315.00	11,309,000	
淀川製鋼所	21,100	2,613.00	55,134,300	
中部鋼板	15,300	1,959.00	29,972,700	
丸一鋼管	56,500	2,808.00	158,652,000	
モリ工業	3,800	2,945.00	11,191,000	
大同特殊鋼	23,400	5,150.00	120,510,000	
日本高周波鋼業	5,700	336.00	1,915,200	
日本冶金工業	13,600	4,365.00	59,364,000	
山陽特殊製鋼	18,300	2,622.00	47,982,600	
愛知製鋼	10,700	2,293.00	24,535,100	
日本金属	3,600	935.00	3,366,000	
大平洋金属	13,200	1,985.00	26,202,000	
新日本電工	118,700	366.00	43,444,200	
栗本鐵工所	8,800	2,013.00	17,714,400	
虹技	2,000	1,005.00	2,010,000	
三菱製鋼	11,700	1,215.00	14,215,500	
日亜鋼業	16,900	272.00	4,596,800	
日本精線	2,500	4,520.00	11,300,000	
エンビプロ・ホールディングス	11,400	712.00	8,116,800	
シンニッタン	18,000	251.00	4,518,000	
新家工業	3,600	2,379.00	8,564,400	
大紀アルミニウム工業所	26,500	1,419.00	37,603,500	

日本軽金属ホールディングス	50,100	1,431.00	71,693,100
三井金属鉱業	54,000	3,375.00	182,250,000
東邦亜鉛	11,000	2,053.00	22,583,000
三菱マテリアル	123,800	2,130.00	263,694,000
住友金属鉱山	215,000	5,183.00	1,114,345,000
DOWAホールディングス	41,700	4,490.00	187,233,000
古河機械金属	27,300	1,369.00	37,373,700
大阪チタニウムテクノロジーズ	27,200	3,190.00	86,768,000
東邦チタニウム	33,600	2,190.00	73,584,000
UACJ	26,000	2,468.00	64,168,000
CKサンエツ	4,500	4,125.00	18,562,500
古河電気工業	61,800	2,399.00	148,258,200
住友電気工業	640,400	1,688.50	1,081,315,400
フジクラ	199,000	967.00	192,433,000
昭和電線ホールディングス	20,800	1,921.00	39,956,800
タツタ電線	37,900	711.00	26,946,900
カナレ電気	2,600	1,302.00	3,385,200
平河ヒューテック	10,800	1,363.00	14,720,400
リョービ	19,900	1,389.00	27,641,100
アーレスティ	18,500	538.00	9,953,000
アサヒホールディングス	75,100	1,965.00	147,571,500
稲葉製作所	10,800	1,386.00	14,968,800
宮地エンジニアリンググループ	5,100	3,645.00	18,589,500
トーカロ	51,000	1,241.00	63,291,000
アルファC o	6,000	973.00	5,838,000
SUMCO	353,000	1,868.00	659,404,000
川田テクノロジーズ	4,400	3,460.00	15,224,000
RS Technologies	12,200	3,565.00	43,493,000
ジェイテックコーポレーション	2,200	2,764.00	6,080,800
信和	9,100	745.00	6,779,500
東洋製罐グループホールディングス	122,700	1,712.00	210,062,400
ホッカンホールディングス	10,000	1,344.00	13,440,000
コロナ	10,400	910.00	9,464,000
横河ブリッジホールディングス	24,500	2,017.00	49,416,500
駒井ハルテック	2,700	1,634.00	4,411,800
高田機工	1,300	2,630.00	3,419,000

三和ホールディングス	170,800	1,413.00	241,340,400	
文化シャッター	53,400	1,138.00	60,769,200	
三協立山	25,500	630.00	16,065,000	
アルインコ	14,100	1,060.00	14,946,000	
東洋シャッター	3,800	510.00	1,938,000	
L I X I L	270,200	2,131.00	575,796,200	
日本ファイルコン	10,700	450.00	4,815,000	
ノーリツ	27,300	1,573.00	42,942,900	
長府製作所	18,700	2,074.00	38,783,800	
リンナイ	33,600	9,720.00	326,592,000	
ダイニチ工業	8,200	667.00	5,469,400	
日東精工	26,900	500.00	13,450,000	
三洋工業	1,900	1,911.00	3,630,900	
岡部	29,800	714.00	21,277,200	
ジーテクト	20,700	1,389.00	28,752,300	
東プレ	32,700	1,168.00	38,193,600	
高周波熱錬	30,200	671.00	20,264,200	
東京製綱	10,900	1,253.00	13,657,700	
サンコール	14,700	620.00	9,114,000	
モリテック スチール	12,100	324.00	3,920,400	
パイオラックス	25,600	1,936.00	49,561,600	
エイチワン	19,100	616.00	11,765,600	
日本発條	164,000	895.00	146,780,000	
中央発條	10,300	702.00	7,230,600	
アドバネクス	2,000	1,063.00	2,126,000	
立川ブラインド工業	8,400	1,269.00	10,659,600	
三益半導体工業	16,700	2,531.00	42,267,700	
日本ドライケミカル	3,900	1,654.00	6,450,600	
日本製鋼所	50,100	2,615.00	131,011,500	
三浦工業	75,800	3,390.00	256,962,000	
タクマ	55,900	1,361.00	76,079,900	
ツガミ	40,500	1,445.00	58,522,500	
オークマ	18,200	5,180.00	94,276,000	
芝浦機械	18,200	2,882.00	52,452,400	
アマダ	289,800	1,194.00	346,021,200	
アイダエンジニアリング	37,600	780.00	29,328,000	

TAKISAWA	4,300	1,106.00	4,755,800	
FUJI	79,000	2,042.00	161,318,000	
牧野フライス製作所	20,100	4,690.00	94,269,000	
オーエスジー	86,800	1,940.00	168,392,000	
ダイジェット工業	1,800	818.00	1,472,400	
旭ダイヤモンド工業	51,000	767.00	39,117,000	
DMG森精機	110,100	2,131.00	234,623,100	
ソディック	50,200	735.00	36,897,000	
ディスコ	29,100	40,300.00	1,172,730,000	
日東工器	8,900	1,675.00	14,907,500	
日進工具	15,200	1,078.00	16,385,600	
パンチ工業	14,200	450.00	6,390,000	
富士ダイス	7,700	582.00	4,481,400	
豊和工業	8,900	976.00	8,686,400	
ニデックオーケーケー	6,500	895.00	5,817,500	
東洋機械金属	11,300	557.00	6,294,100	
エンシュウ	3,600	701.00	2,523,600	
島精機製作所	29,000	1,843.00	53,447,000	
オプトラン	26,900	2,041.00	54,902,900	
NCホールディングス	3,300	1,934.00	6,382,200	
イワキポンプ	12,200	1,274.00	15,542,800	
フリー	19,100	1,181.00	22,557,100	
ヤマシンフィルタ	43,500	401.00	17,443,500	
日阪製作所	17,700	908.00	16,071,600	
やまびこ	29,700	1,231.00	36,560,700	
野村マイクロ・サイエンス	6,200	4,465.00	27,683,000	
平田機工	8,700	6,490.00	56,463,000	
ペガサスミシン製造	20,200	667.00	13,473,400	
マルマエ	8,800	1,860.00	16,368,000	
タツモ	10,000	1,658.00	16,580,000	
ナブテスコ	114,000	3,655.00	416,670,000	
三井海洋開発	22,800	1,523.00	34,724,400	
レオン自動機	19,200	1,195.00	22,944,000	
SMC	58,900	67,100.00	3,952,190,000	
ホソカワミクロン	13,900	2,617.00	36,376,300	
ユニオンツール	8,000	3,230.00	25,840,000	

オイレス工業	25,400	1,618.00	41,097,200	
日精エー・エス・ビー機械	8,300	4,260.00	35,358,000	
サトーホールディングス	25,900	2,288.00	59,259,200	
技研製作所	19,000	2,796.00	53,124,000	
日本エアータック	9,200	1,096.00	10,083,200	
カワタ	4,800	847.00	4,065,600	
日精樹脂工業	13,700	968.00	13,261,600	
オカダアイヨン	5,000	1,598.00	7,990,000	
ワイエイシイホールディングス	6,900	2,238.00	15,442,200	
小松製作所	850,600	3,262.00	2,774,657,200	
住友重機械工業	107,500	2,923.00	314,222,500	
日立建機	72,400	3,065.00	221,906,000	
日工	27,200	627.00	17,054,400	
巴工業	7,800	2,401.00	18,727,800	
井関農機	17,100	1,172.00	20,041,200	
TOWA	18,600	1,795.00	33,387,000	
丸山製作所	2,800	1,688.00	4,726,400	
北川鉄工所	7,300	1,106.00	8,073,800	
ローツェ	9,500	10,210.00	96,995,000	
タカキタ	4,700	446.00	2,096,200	
クボタ	960,700	2,047.00	1,966,552,900	
荏原実業	8,800	2,860.00	25,168,000	
三菱化工機	5,900	2,205.00	13,009,500	
月島機械	24,700	1,118.00	27,614,600	
帝国電機製作所	13,200	2,568.00	33,897,600	
新東工業	36,900	740.00	27,306,000	
澁谷工業	17,100	2,382.00	40,732,200	
アイチ コーポレーション	25,900	773.00	20,020,700	
小森コーポレーション	42,300	869.00	36,758,700	
鶴見製作所	14,000	2,002.00	28,028,000	
日本ギア工業	5,600	482.00	2,699,200	
酒井重工業	2,600	3,735.00	9,711,000	
荏原製作所	74,300	5,550.00	412,365,000	
石井鐵工所	1,900	2,319.00	4,406,100	
西島製作所	15,800	1,510.00	23,858,000	
北越工業	18,300	1,426.00	26,095,800	

ダイキン工業	216,700	23,085.00	5,002,519,500	
オルガノ	25,000	3,355.00	83,875,000	
トーヨーカネツ	7,000	2,625.00	18,375,000	
栗田工業	101,600	6,020.00	611,632,000	
椿本チエイン	25,800	3,075.00	79,335,000	
大同工業	6,700	740.00	4,958,000	
木村化工機	14,100	725.00	10,222,500	
アネスト岩田	31,000	910.00	28,210,000	
ダイフク	93,600	7,270.00	680,472,000	
サムコ	6,000	3,490.00	20,940,000	
加藤製作所	7,800	860.00	6,708,000	
油研工業	2,500	1,957.00	4,892,500	
タダノ	95,900	1,005.00	96,379,500	
フジテック	66,500	3,265.00	217,122,500	
C K D	50,300	2,018.00	101,505,400	
平和	60,400	2,342.00	141,456,800	
理想科学工業	16,200	2,370.00	38,394,000	
SANKYO	35,700	5,630.00	200,991,000	
日本金銭機械	20,000	1,247.00	24,940,000	
マースグループホールディングス	10,700	2,499.00	26,739,300	
フクシマガリレイ	13,400	4,275.00	57,285,000	
オーイズミ	6,200	478.00	2,963,600	
ダイコク電機	10,000	2,616.00	26,160,000	
竹内製作所	33,000	2,926.00	96,558,000	
アマノ	51,600	2,476.00	127,761,600	
JUKI	28,300	629.00	17,800,700	
ジャノメ	18,500	613.00	11,340,500	
マックス	22,400	2,119.00	47,465,600	
グローリー	47,100	2,651.00	124,862,100	
新晃工業	18,400	1,538.00	28,299,200	
大和冷機工業	27,900	1,207.00	33,675,300	
セガサミーホールディングス	146,000	2,396.00	349,816,000	
日本ピストンリング	5,500	1,290.00	7,095,000	
リケン	7,200	2,550.00	18,360,000	
T P R	21,300	1,372.00	29,223,600	
ツバキ・ナカシマ	44,800	1,069.00	47,891,200	

ホシザキ	116,900	4,655.00	544,169,500	
大豊工業	15,800	631.00	9,969,800	
日本精工	333,600	741.00	247,197,600	
NTN	357,900	334.00	119,538,600	
ジェイテクト	161,600	1,016.00	164,185,600	
不二越	13,400	3,855.00	51,657,000	
日本トムソン	44,600	623.00	27,785,800	
THK	104,800	2,857.00	299,413,600	
ユーシン精機	14,500	712.00	10,324,000	
前澤給装工業	12,900	965.00	12,448,500	
イーグル工業	20,200	1,163.00	23,492,600	
前澤工業	9,400	624.00	5,865,600	
日本ピラー工業	16,900	3,340.00	56,446,000	
キッツ	67,000	872.00	58,424,000	
マキタ	225,900	3,505.00	791,779,500	
三井E&Sホールディングス	82,500	428.00	35,310,000	
日立造船	149,000	887.00	132,163,000	
三菱重工業	317,500	5,084.00	1,614,170,000	
IHI	114,400	3,695.00	422,708,000	
スター精密	34,300	1,624.00	55,703,200	
日清紡ホールディングス	147,800	983.00	145,287,400	
イビデン	104,200	4,565.00	475,673,000	
コニカミノルタ	406,200	587.00	238,439,400	
ブラザー工業	242,800	1,989.00	482,929,200	
ミネベアミツミ	316,000	2,420.00	764,720,000	
日立製作所	883,000	6,988.00	6,170,404,000	
東芝	349,400	4,340.00	1,516,396,000	
三菱電機	1,876,200	1,529.00	2,868,709,800	
富士電機	110,400	5,230.00	577,392,000	
東洋電機製造	5,200	874.00	4,544,800	
安川電機	215,100	5,130.00	1,103,463,000	
シンフォニアテクノロジー	20,000	1,615.00	32,300,000	
明電舎	27,500	1,919.00	52,772,500	
オリジン	3,600	1,251.00	4,503,600	
山洋電気	7,900	5,600.00	44,240,000	
デンヨー	13,800	1,562.00	21,555,600	

PHCホールディングス	25,500	1,409.00	35,929,500	
ソシオネクスト	18,700	8,260.00	154,462,000	
東芝テック	27,100	3,810.00	103,251,000	
芝浦メカトロニクス	3,500	13,380.00	46,830,000	
マブチモーター	45,200	3,765.00	170,178,000	
日本電産	440,900	7,025.00	3,097,322,500	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	14,200	470.00	6,674,000	
トレックス・セミコンダクター	8,700	2,519.00	21,915,300	
東光高岳	11,100	2,012.00	22,333,200	
ダブル・スコープ	59,300	1,375.00	81,537,500	
ダイヘン	16,400	4,190.00	68,716,000	
ヤーマン	35,600	1,408.00	50,124,800	
JVCケンウッド	166,600	389.00	64,807,400	
ミマキエンジニアリング	17,900	561.00	10,041,900	
IPEX	10,400	1,182.00	12,292,800	
日新電機	43,500	1,696.00	73,776,000	
大崎電気工業	43,000	526.00	22,618,000	
オムロン	166,300	7,305.00	1,214,821,500	
日東工業	24,500	2,622.00	64,239,000	
IDEC	26,800	3,280.00	87,904,000	
正興電機製作所	6,600	978.00	6,454,800	
不二電機工業	3,600	1,111.00	3,999,600	
ジーエス・ユアサコーポレーション	59,800	2,461.00	147,167,800	
サクサホールディングス	3,400	1,454.00	4,943,600	
メルコホールディングス	5,000	3,290.00	16,450,000	
テクノメディカ	4,700	1,736.00	8,159,200	
日本電気	256,700	4,770.00	1,224,459,000	
富士通	180,900	17,695.00	3,201,025,500	
沖電気工業	82,100	711.00	58,373,100	
岩崎通信機	7,000	782.00	5,474,000	
電気興業	7,300	2,107.00	15,381,100	
サンケン電気	16,900	8,750.00	147,875,000	
ナカヨ	2,600	1,177.00	3,060,200	
アイホン	11,000	1,941.00	21,351,000	
ルネサスエレクトロニクス	1,184,800	1,706.00	2,021,268,800	
セイコーエプソン	241,700	1,853.00	447,870,100	

ワコム	144,500	662.00	95,659,000	
アルバック	43,100	5,230.00	225,413,000	
アクセル	6,300	1,752.00	11,037,600	
E I Z O	13,300	3,685.00	49,010,500	
日本信号	41,300	1,028.00	42,456,400	
京三製作所	38,000	409.00	15,542,000	
能美防災	24,800	1,675.00	41,540,000	
ホーチキ	13,900	1,439.00	20,002,100	
星和電機	7,400	457.00	3,381,800	
エレコム	43,700	1,312.00	57,334,400	
パナソニック ホールディングス	2,144,300	1,203.50	2,580,665,050	
シャープ	218,600	969.00	211,823,400	
アンリツ	127,800	1,251.00	159,877,800	
富士通ゼネラル	51,400	3,710.00	190,694,000	
ソニーグループ	1,271,400	11,480.00	14,595,672,000	
T D K	287,500	4,595.00	1,321,062,500	
帝国通信工業	8,500	1,451.00	12,333,500	
タムラ製作所	77,900	753.00	58,658,700	
アルプスアルパイン	162,500	1,443.00	234,487,500	
池上通信機	5,100	601.00	3,065,100	
日本電波工業	22,100	1,417.00	31,315,700	
鈴木	11,100	1,004.00	11,144,400	
メイコー	20,000	2,801.00	56,020,000	
日本トリム	4,200	2,845.00	11,949,000	
ローランド ディー. ジー.	10,400	3,055.00	31,772,000	
フォスター電機	16,800	947.00	15,909,600	
SMK	4,400	2,497.00	10,986,800	
ヨコオ	14,600	2,030.00	29,638,000	
ホシデン	43,800	1,589.00	69,598,200	
ヒロセ電機	30,000	16,920.00	507,600,000	
日本航空電子工業	37,200	2,266.00	84,295,200	
T O A	20,700	777.00	16,083,900	
マクセル	39,700	1,462.00	58,041,400	
古野電気	24,100	933.00	22,485,300	
スミダコーポレーション	16,900	1,684.00	28,459,600	
アイコム	7,000	2,565.00	17,955,000	

リオン	7,700	1,848.00	14,229,600	
横河電機	198,600	2,086.00	414,279,600	
新電元工業	6,900	3,445.00	23,770,500	
アズビル	125,600	3,600.00	452,160,000	
東亜ディーケーケー	8,100	786.00	6,366,600	
日本光電工業	83,200	3,385.00	281,632,000	
チノー	7,500	1,905.00	14,287,500	
共和電業	15,100	333.00	5,028,300	
日本電子材料	11,900	1,508.00	17,945,200	
堀場製作所	40,000	7,030.00	281,200,000	
アドバンテスト	141,600	10,050.00	1,423,080,000	
小野測器	7,000	405.00	2,835,000	
エスペック	14,600	2,006.00	29,287,600	
キーエンス	179,800	58,870.00	10,584,826,000	
日置電機	9,500	7,970.00	75,715,000	
シスメックス	155,100	8,355.00	1,295,860,500	
日本マイクロニクス	29,900	1,301.00	38,899,900	
メガチップス	14,900	2,874.00	42,822,600	
OBARA GROUP	8,500	3,875.00	32,937,500	
澤藤電機	2,200	1,140.00	2,508,000	
原田工業	7,500	858.00	6,435,000	
コーセル	24,400	1,081.00	26,376,400	
イリソ電子工業	16,600	4,855.00	80,593,000	
オブテックスグループ	33,200	2,032.00	67,462,400	
千代田インテグレ	6,400	2,168.00	13,875,200	
レーザーテック	82,400	22,285.00	1,836,284,000	
スタンレー電気	128,100	2,862.00	366,622,200	
岩崎電気	6,000	4,450.00	26,700,000	
ウシオ電機	94,200	1,554.00	146,386,800	
岡谷電機産業	14,000	285.00	3,990,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	15,700	402.00	6,311,400	
エノモト	4,300	1,800.00	7,740,000	
日本セラミック	18,500	2,740.00	50,690,000	
遠藤照明	7,700	770.00	5,929,000	
古河電池	13,600	1,135.00	15,436,000	
双信電機	7,600	371.00	2,819,600	

山一電機	15,900	1,784.00	28,365,600	
図研	15,800	3,480.00	54,984,000	
日本電子	45,100	4,020.00	181,302,000	
カシオ計算機	133,900	1,355.00	181,434,500	
ファナック	176,400	22,760.00	4,014,864,000	
日本シイエムケイ	39,000	501.00	19,539,000	
エンプラス	5,400	3,890.00	21,006,000	
大真空	22,500	751.00	16,897,500	
ローム	83,100	10,590.00	880,029,000	
浜松ホトニクス	144,300	6,640.00	958,152,000	
三井ハイテック	18,600	6,910.00	128,526,000	
新光電気工業	63,700	3,790.00	241,423,000	
京セラ	279,300	6,626.00	1,850,641,800	
太陽誘電	87,600	4,195.00	367,482,000	
村田製作所	545,100	7,515.00	4,096,426,500	
双葉電子工業	35,000	549.00	19,215,000	
北陸電気工業	6,300	1,385.00	8,725,500	
ニチコン	37,000	1,312.00	48,544,000	
日本ケミコン	18,000	2,108.00	37,944,000	
KOA	27,400	1,865.00	51,101,000	
市光工業	27,100	442.00	11,978,200	
小糸製作所	216,400	2,283.00	494,041,200	
ミツバ	33,700	500.00	16,850,000	
S C R E E Nホールディングス	30,700	10,290.00	315,903,000	
キヤノン電子	20,100	1,737.00	34,913,700	
キヤノン	986,100	2,933.00	2,892,231,300	
リコー	450,700	1,031.00	464,671,700	
象印マホービン	54,000	1,618.00	87,372,000	
M U T O Hホールディングス	2,400	1,651.00	3,962,400	
東京エレクトロン	126,800	46,190.00	5,856,892,000	
イノテック	12,300	1,312.00	16,137,600	
トヨタ紡織	75,700	2,093.00	158,440,100	
芦森工業	2,900	1,448.00	4,199,200	
ユニプレス	32,300	753.00	24,321,900	
豊田自動織機	131,400	7,770.00	1,020,978,000	
モリタホールディングス	31,500	1,184.00	37,296,000	

三櫻工業	27,400	675.00	18,495,000	
デンソー	370,700	7,404.00	2,744,662,800	
東海理化電機製作所	50,700	1,511.00	76,607,700	
川崎重工業	135,400	3,040.00	411,616,000	
名村造船所	41,000	354.00	14,514,000	
日本車輛製造	6,900	1,951.00	13,461,900	
三菱ロジスネクスト	28,700	835.00	23,964,500	
近畿車輛	2,200	1,167.00	2,567,400	
日産自動車	2,553,200	518.70	1,324,344,840	
いすゞ自動車	522,500	1,641.00	857,422,500	
トヨタ自動車	9,869,300	1,907.50	18,825,689,750	
日野自動車	231,700	568.00	131,605,600	
三菱自動車工業	701,200	540.00	378,648,000	
エフテック	11,100	589.00	6,537,900	
レシップホールディングス	6,300	467.00	2,942,100	
GMB	3,100	771.00	2,390,100	
ファルテック	2,500	592.00	1,480,000	
武蔵精密工業	43,900	1,826.00	80,161,400	
日産車体	31,700	896.00	28,403,200	
新明和工業	56,500	1,073.00	60,624,500	
極東開発工業	31,600	1,447.00	45,725,200	
トピー工業	14,600	1,795.00	26,207,000	
ティラド	4,500	2,222.00	9,999,000	
曙ブレーキ工業	109,700	147.00	16,125,900	
タチエス	28,400	1,227.00	34,846,800	
NOK	69,800	1,264.00	88,227,200	
フタバ産業	48,200	401.00	19,328,200	
KYB	17,300	3,645.00	63,058,500	
大同メタル工業	35,100	501.00	17,585,100	
プレス工業	80,300	449.00	36,054,700	
ミクニ	18,300	341.00	6,240,300	
太平洋工業	41,200	1,118.00	46,061,600	
河西工業	21,300	210.00	4,473,000	
アイシン	138,600	3,750.00	519,750,000	
マツダ	594,500	1,172.00	696,754,000	
今仙電機製作所	10,100	781.00	7,888,100	

本田技研工業	1,461,000	3,438.00	5,022,918,000	
スズキ	330,100	4,810.00	1,587,781,000	
S U B A R U	568,700	2,215.00	1,259,670,500	
安永	7,000	684.00	4,788,000	
ヤマハ発動機	282,500	3,385.00	956,262,500	
T B K	15,800	247.00	3,902,600	
エクセディ	29,400	1,768.00	51,979,200	
豊田合成	52,500	2,163.00	113,557,500	
愛三工業	29,700	864.00	25,660,800	
盟和産業	2,300	956.00	2,198,800	
日本プラスト	12,500	398.00	4,975,000	
ヨロズ	16,800	740.00	12,432,000	
エフ・シー・シー	31,800	1,460.00	46,428,000	
シマノ	73,500	21,880.00	1,608,180,000	
テイ・エス テック	82,300	1,722.00	141,720,600	
ジャムコ	8,700	1,770.00	15,399,000	
テルモ	561,600	3,729.00	2,094,206,400	
クリエートメディック	5,200	882.00	4,586,400	
日機装	45,000	941.00	42,345,000	
日本エム・ディ・エム	10,700	1,019.00	10,903,300	
島津製作所	218,900	3,865.00	846,048,500	
J M S	16,700	511.00	8,533,700	
長野計器	13,100	1,184.00	15,510,400	
ブイ・テクノロジー	8,800	2,535.00	22,308,000	
東京計器	13,800	1,269.00	17,512,200	
愛知時計電機	7,000	1,450.00	10,150,000	
インターアクション	10,800	1,434.00	15,487,200	
オーバル	14,100	457.00	6,443,700	
東京精密	39,400	4,735.00	186,559,000	
マニー	79,100	1,864.00	147,442,400	
ニコン	279,400	1,270.00	354,838,000	
トプコン	94,600	1,706.00	161,387,600	
オリンパス	1,123,600	2,301.50	2,585,965,400	
理研計器	11,100	5,050.00	56,055,000	
タムロン	13,500	3,155.00	42,592,500	
HOYA	383,900	13,470.00	5,171,133,000	

シード	8,100	554.00	4,487,400	
ノーリツ鋼機	17,000	2,111.00	35,887,000	
A&Dホロンホールディングス	26,200	1,237.00	32,409,400	
朝日インテック	200,900	2,372.00	476,534,800	
シチズン時計	197,700	800.00	158,160,000	
リズム	5,000	1,518.00	7,590,000	
大研医器	12,000	468.00	5,616,000	
メニコン	61,700	3,000.00	185,100,000	
シンシア	1,500	500.00	750,000	
松風	8,100	2,134.00	17,285,400	
セイコーグループ	27,800	2,932.00	81,509,600	
ニプロ	149,800	1,074.00	160,885,200	
KYORITSU	23,700	126.00	2,986,200	
中本ボックス	4,800	1,627.00	7,809,600	
スノーピーク	30,800	2,142.00	65,973,600	
パラマウントベッドホールディングス	41,500	2,363.00	98,064,500	
トランザクション	13,800	1,579.00	21,790,200	
粧美堂	4,300	377.00	1,621,100	
ニホンフラッシュ	16,800	921.00	15,472,800	
前田工織	15,200	3,245.00	49,324,000	
永大産業	17,000	219.00	3,723,000	
アートネイチャー	18,500	746.00	13,801,000	
バンダイナムコホールディングス	164,100	8,591.00	1,409,783,100	
アイフイスジャパン	4,400	597.00	2,626,800	
SHOEI	19,000	5,080.00	96,520,000	
フランスベッドホールディングス	22,300	981.00	21,876,300	
パイロットコーポレーション	28,100	4,380.00	123,078,000	
萩原工業	12,000	1,200.00	14,400,000	
フジシールインターナショナル	36,400	1,600.00	58,240,000	
タカラトミー	83,000	1,297.00	107,651,000	
広済堂ホールディングス	10,700	2,335.00	24,984,500	
エステールホールディングス	3,700	631.00	2,334,700	
タカノ	5,900	672.00	3,964,800	
プロネクサス	14,900	977.00	14,557,300	
ホクシン	12,200	148.00	1,805,600	
ウッドワン	5,300	901.00	4,775,300	

大建工業	10,900	2,101.00	22,900,900	
凸版印刷	235,100	2,375.00	558,362,500	
大日本印刷	213,200	3,615.00	770,718,000	
共同印刷	5,100	2,935.00	14,968,500	
N I S S H A	34,200	1,786.00	61,081,200	
光村印刷	1,300	1,221.00	1,587,300	
TAKARA & COMPANY	12,400	2,158.00	26,759,200	
アシックス	165,900	3,275.00	543,322,500	
ツツミ	4,000	1,955.00	7,820,000	
ローランド	13,200	3,850.00	50,820,000	
小松ウオール工業	6,600	1,914.00	12,632,400	
ヤマハ	113,300	4,950.00	560,835,000	
河合楽器製作所	4,800	2,623.00	12,590,400	
クリナップ	20,100	630.00	12,663,000	
ピジョン	114,500	2,184.00	250,068,000	
兼松サステック	1,100	2,245.00	2,469,500	
キングジム	15,900	881.00	14,007,900	
リンテック	36,100	2,187.00	78,950,700	
イトーキ	36,800	779.00	28,667,200	
任天堂	1,134,800	5,456.00	6,191,468,800	
三菱鉛筆	25,500	1,459.00	37,204,500	
タカラスタンダード	34,800	1,388.00	48,302,400	
コクヨ	86,500	1,805.00	156,132,500	
ナカバヤシ	19,400	480.00	9,312,000	
グローブライト	14,500	2,584.00	37,468,000	
オカムラ	54,100	1,320.00	71,412,000	
美津濃	17,900	2,945.00	52,715,500	
東京電力ホールディングス	1,620,200	470.00	761,494,000	
中部電力	662,300	1,421.00	941,128,300	
関西電力	694,100	1,280.00	888,448,000	
中国電力	286,200	687.00	196,619,400	
北陸電力	169,600	552.00	93,619,200	
東北電力	439,400	663.00	291,322,200	
四国電力	153,400	739.00	113,362,600	
九州電力	414,300	740.00	306,582,000	
北海道電力	173,600	475.00	82,460,000	

沖縄電力	42,100	1,041.00	43,826,100	
電源開発	135,300	2,127.00	287,783,100	
エフオン	13,100	570.00	7,467,000	
イーレックス	31,900	1,981.00	63,193,900	
レノバ	47,800	2,192.00	104,777,600	
東京瓦斯	380,000	2,678.00	1,017,640,000	
大阪瓦斯	364,100	2,143.00	780,266,300	
東邦瓦斯	70,700	2,510.00	177,457,000	
北海道瓦斯	10,700	1,756.00	18,789,200	
広島ガス	37,900	344.00	13,037,600	
西部ガスホールディングス	16,900	1,737.00	29,355,300	
静岡ガス	41,000	1,108.00	45,428,000	
メタウォーター	22,500	1,640.00	36,900,000	
SBSホールディングス	16,000	3,255.00	52,080,000	
東武鉄道	197,400	2,999.00	592,002,600	
相鉄ホールディングス	59,400	2,273.00	135,016,200	
東急	504,000	1,574.00	793,296,000	
京浜急行電鉄	203,900	1,263.00	257,525,700	
小田急電鉄	272,400	1,610.00	438,564,000	
京王電鉄	95,000	4,660.00	442,700,000	
京成電鉄	115,900	3,805.00	440,999,500	
富士急行	22,100	4,150.00	91,715,000	
東日本旅客鉄道	304,800	6,845.00	2,086,356,000	
西日本旅客鉄道	229,600	5,217.00	1,197,823,200	
東海旅客鉄道	138,500	15,220.00	2,107,970,000	
西武ホールディングス	217,400	1,398.00	303,925,200	
鴻池運輸	30,600	1,449.00	44,339,400	
西日本鉄道	48,000	2,412.00	115,776,000	
ハマキョウレックス	14,100	3,155.00	44,485,500	
サカイ引越センター	8,500	4,420.00	37,570,000	
近鉄グループホールディングス	179,400	4,055.00	727,467,000	
阪急阪神ホールディングス	239,300	3,820.00	914,126,000	
南海電気鉄道	85,700	2,756.00	236,189,200	
京阪ホールディングス	74,200	3,325.00	246,715,000	
神戸電鉄	4,900	3,175.00	15,557,500	
名古屋鉄道	198,300	2,069.00	410,282,700	

山陽電気鉄道	13,500	2,202.00	29,727,000	
アルプス物流	14,300	1,296.00	18,532,800	
ヤマトホールディングス	229,800	2,320.00	533,136,000	
山九	45,700	4,905.00	224,158,500	
丸運	7,800	220.00	1,716,000	
丸全昭和運輸	11,100	3,040.00	33,744,000	
センコーグループホールディングス	95,000	974.00	92,530,000	
トナミホールディングス	3,900	3,805.00	14,839,500	
ニッコンホールディングス	57,400	2,450.00	140,630,000	
日本石油輸送	1,600	2,315.00	3,704,000	
福山通運	13,600	3,350.00	45,560,000	
セイノーホールディングス	111,700	1,372.00	153,252,400	
エスライン	4,500	815.00	3,667,500	
神奈川中央交通	5,100	3,270.00	16,677,000	
AZ-COM丸和ホールディングス	43,300	1,792.00	77,593,600	
C&Fロジホールディングス	17,300	1,211.00	20,950,300	
九州旅客鉄道	126,900	2,913.00	369,659,700	
SGホールディングス	344,300	2,076.00	714,766,800	
NIPPON EXPRESSホールディングス	67,000	7,540.00	505,180,000	
日本郵船	480,600	3,355.00	1,612,413,000	
商船三井	316,800	3,435.00	1,088,208,000	
川崎汽船	153,400	3,335.00	511,589,000	
NSユニテッド海運	10,100	4,140.00	41,814,000	
飯野海運	67,600	964.00	65,166,400	
共栄タンカー	4,300	958.00	4,119,400	
乾汽船	23,600	2,044.00	48,238,400	
日本航空	440,700	2,565.00	1,130,395,500	
ANAホールディングス	488,300	2,792.00	1,363,333,600	
パスコ	3,100	1,393.00	4,318,300	
トランコム	5,200	6,830.00	35,516,000	
日新	13,600	2,046.00	27,825,600	
三菱倉庫	38,600	3,100.00	119,660,000	
三井倉庫ホールディングス	16,800	4,020.00	67,536,000	
住友倉庫	49,300	2,083.00	102,691,900	
澁澤倉庫	7,200	2,149.00	15,472,800	

東陽倉庫	21,200	270.00	5,724,000	
日本トランスシティ	36,100	556.00	20,071,600	
ケイヒン	2,800	1,510.00	4,228,000	
中央倉庫	8,600	973.00	8,367,800	
川西倉庫	2,700	1,002.00	2,705,400	
安田倉庫	12,200	945.00	11,529,000	
ファイズホールディングス	2,900	1,143.00	3,314,700	
東洋埠頭	4,600	1,341.00	6,168,600	
上組	86,000	2,687.00	231,082,000	
サンリツ	3,600	747.00	2,689,200	
キムラユニティー	7,600	981.00	7,455,600	
キューソー流通システム	9,500	941.00	8,939,500	
東海運	9,300	287.00	2,669,100	
エーアイテイナー	11,300	1,565.00	17,684,500	
内外トランスライン	6,500	2,156.00	14,014,000	
日本コンセプト	5,600	1,304.00	7,302,400	
NEC ネットエスアイ	60,300	1,611.00	97,143,300	
クロスキャット	10,400	1,276.00	13,270,400	
システナ	303,600	342.00	103,831,200	
デジタルアーツ	11,400	5,450.00	62,130,000	
日鉄ソリューションズ	30,800	3,335.00	102,718,000	
キューブシステム	10,900	1,108.00	12,077,200	
コア	8,100	1,514.00	12,263,400	
手間いらず	3,100	4,850.00	15,035,000	
ラクーンホールディングス	18,100	1,117.00	20,217,700	
ソリトンシステムズ	9,500	1,008.00	9,576,000	
ソフトクリエイトホールディングス	7,500	3,470.00	26,025,000	
T I S	202,600	3,430.00	694,918,000	
J N S ホールディングス	7,900	331.00	2,614,900	
グリー	48,600	676.00	32,853,600	
GMOペパボ	2,700	1,823.00	4,922,100	
コーエーテクモホールディングス	113,000	2,413.00	272,669,000	
三菱総合研究所	8,900	5,210.00	46,369,000	
電算	2,000	1,912.00	3,824,000	
A G S	7,000	695.00	4,865,000	
ファインデックス	14,700	627.00	9,216,900	

ブレインパッド	18,300	628.00	11,492,400	
K L a b	35,500	385.00	13,667,500	
ポールトゥウィンホールディングス	31,000	849.00	26,319,000	
ネクソン	466,000	3,075.00	1,432,950,000	
アイスタイル	58,100	438.00	25,447,800	
エムアップホールディングス	22,200	1,049.00	23,287,800	
エイチーム	13,600	779.00	10,594,400	
エニグモ	23,300	592.00	13,793,600	
テクノスジャパン	13,600	602.00	8,187,200	
コロプラ	70,200	592.00	41,558,400	
ブロードリーフ	105,800	439.00	46,446,200	
クロス・マーケティンググループ	7,500	637.00	4,777,500	
デジタルハーツホールディングス	11,400	1,486.00	16,940,400	
システム情報	16,200	792.00	12,830,400	
メディアドゥ	7,400	1,515.00	11,211,000	
じげん	53,100	415.00	22,036,500	
ブイキューブ	21,900	606.00	13,271,400	
エンカレッジ・テクノロジー	4,100	491.00	2,013,100	
サイバーリンクス	5,300	903.00	4,785,900	
フィックスターズ	20,500	1,378.00	28,249,000	
CARTA HOLDINGS	8,600	1,462.00	12,573,200	
オブティム	15,000	980.00	14,700,000	
セレス	7,400	1,123.00	8,310,200	
SHIFT	13,200	22,480.00	296,736,000	
ティーガイア	19,000	1,644.00	31,236,000	
セック	2,300	3,380.00	7,774,000	
テクマトリックス	33,000	1,554.00	51,282,000	
プロシップ	8,000	1,390.00	11,120,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	55,300	2,364.00	130,729,200	
GMOペイメントゲートウェイ	41,200	11,480.00	472,976,000	
ザッパラス	5,000	350.00	1,750,000	
システムリサーチ	5,700	2,199.00	12,534,300	
インターネットイニシアティブ	100,700	2,650.00	266,855,000	
さくらインターネット	20,700	598.00	12,378,600	
ヴィンクス	4,900	1,392.00	6,820,800	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,600	4,020.00	22,512,000	

S R Aホールディングス	9,300	3,035.00	28,225,500	
システムインテグレータ	5,300	419.00	2,220,700	
朝日ネット	19,700	586.00	11,544,200	
e B A S E	25,700	650.00	16,705,000	
アバントグループ	22,900	1,311.00	30,021,900	
アドソル日進	7,700	1,433.00	11,034,100	
ODKソリューションズ	3,900	590.00	2,301,000	
フリービット	11,200	1,118.00	12,521,600	
コムチュア	23,900	2,259.00	53,990,100	
サイバーコム	2,700	1,405.00	3,793,500	
アステリア	14,400	727.00	10,468,800	
アイル	10,200	1,940.00	19,788,000	
マークライズ	9,800	2,693.00	26,391,400	
メディカル・データ・ビジョン	27,100	904.00	24,498,400	
g u m i	29,700	841.00	24,977,700	
ショーケース	4,400	328.00	1,443,200	
モバイルファクトリー	3,600	894.00	3,218,400	
テラスカイ	7,900	1,957.00	15,460,300	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	9,500	1,605.00	15,247,500	
P C Iホールディングス	6,900	1,000.00	6,900,000	
アイビーシー	3,000	404.00	1,212,000	
ネオジャパン	6,200	951.00	5,896,200	
P R T I M E S	4,600	1,845.00	8,487,000	
ラクス	85,400	1,720.00	146,888,000	
ランドコンピュータ	4,100	989.00	4,054,900	
ダブルスタンダード	7,400	2,017.00	14,925,800	
オープンドア	12,700	1,613.00	20,485,100	
アカツキ	8,600	2,132.00	18,335,200	
ベネフィットジャパン	1,100	1,186.00	1,304,600	
U b i c o mホールディングス	5,700	1,935.00	11,029,500	
カナミックネットワーク	26,300	518.00	13,623,400	
ノムラシステムコーポレーション	16,800	113.00	1,898,400	
チェンジ	44,200	2,604.00	115,096,800	
シンクロ・フード	10,600	519.00	5,501,400	
オークネット	9,000	1,778.00	16,002,000	
キャピタル・アセット・プランニング	3,400	599.00	2,036,600	

セグエグループ	4,600	784.00	3,606,400
エイトレッド	2,600	1,498.00	3,894,800
マクロミル	41,000	1,055.00	43,255,000
ビーグリー	2,900	1,262.00	3,659,800
オロ	5,500	1,810.00	9,955,000
ユーザーローカル	6,600	1,653.00	10,909,800
テモナ	3,800	296.00	1,124,800
ニーズウェル	5,200	865.00	4,498,000
マネーフォワード	43,400	4,830.00	209,622,000
サインポスト	6,200	588.00	3,645,600
Sun Asterisk	9,700	1,184.00	11,484,800
電算システムホールディングス	8,800	2,524.00	22,211,200
Appier Group	51,300	1,778.00	91,211,400
ソルクシーズ	13,600	352.00	4,787,200
フェイス	4,900	505.00	2,474,500
プロトコーポレーション	22,700	1,244.00	28,238,800
ハイマックス	5,800	1,424.00	8,259,200
野村総合研究所	369,900	2,970.00	1,098,603,000
サイバネットシステム	15,300	985.00	15,070,500
CEホールディングス	8,600	538.00	4,626,800
日本システム技術	6,800	1,703.00	11,580,400
インテージホールディングス	24,600	1,679.00	41,303,400
東邦システムサイエンス	4,700	1,052.00	4,944,400
ソースネクスト	92,300	236.00	21,782,800
インフォコム	23,300	2,373.00	55,290,900
シンプレクス・ホールディングス	30,300	2,311.00	70,023,300
HEROZ	6,300	1,048.00	6,602,400
ラクスル	51,000	1,373.00	70,023,000
メルカリ	81,200	2,539.00	206,166,800
I P S	5,900	2,654.00	15,658,600
F I G	19,100	302.00	5,768,200
システムサポート	7,800	1,732.00	13,509,600
イーソル	11,800	721.00	8,507,800
アルテリア・ネットワークス	17,000	1,276.00	21,692,000
東海ソフト	2,600	908.00	2,360,800
ウイングアーク1st	18,600	1,809.00	33,647,400

ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,900	1,564.00	7,663,600	
サーバーワークス	3,700	2,293.00	8,484,100	
東名	1,300	2,265.00	2,944,500	
ヴィッツ	1,800	915.00	1,647,000	
トビラシステムズ	4,300	823.00	3,538,900	
S a n s a n	59,100	1,540.00	91,014,000	
L i n k - U	3,300	978.00	3,227,400	
ギフトィ	19,500	2,727.00	53,176,500	
メドレー	18,200	4,405.00	80,171,000	
ベース	6,200	4,710.00	29,202,000	
J M D C	29,600	4,360.00	129,056,000	
フォーカスシステムズ	13,300	1,004.00	13,353,200	
クレスコ	14,000	1,756.00	24,584,000	
フジ・メディア・ホールディングス	173,400	1,117.00	193,687,800	
オービック	60,300	20,190.00	1,217,457,000	
ジャストシステム	26,000	3,435.00	89,310,000	
T D C ソフト	15,300	1,508.00	23,072,400	
Zホールディングス	2,565,900	381.80	979,660,620	
トレンドマイクロ	104,100	6,340.00	659,994,000	
I Dホールディングス	12,400	997.00	12,362,800	
日本オラクル	34,500	9,270.00	319,815,000	
アルファシステムズ	5,700	4,290.00	24,453,000	
フューチャー	45,000	1,812.00	81,540,000	
C A C H o l d i n g s	11,200	1,621.00	18,155,200	
S Bテクノロジー	7,800	1,974.00	15,397,200	
トーセ	4,500	748.00	3,366,000	
オービックビジネスコンサルタント	35,500	4,780.00	169,690,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	96,900	3,060.00	296,514,000	
アイティフォー	24,000	861.00	20,664,000	
東計電算	2,600	5,880.00	15,288,000	
エクスネット	2,400	1,015.00	2,436,000	
大塚商会	102,200	4,560.00	466,032,000	
サイボウズ	24,900	2,603.00	64,814,700	
電通国際情報サービス	22,000	4,805.00	105,710,000	
A C C E S S	21,500	981.00	21,091,500	

デジタルガレージ	32,000	4,535.00	145,120,000	
EMシステムズ	30,300	849.00	25,724,700	
ウェザーニューズ	6,400	6,830.00	43,712,000	
C I J	16,700	1,030.00	17,201,000	
ビジネスエンジニアリング	3,500	2,754.00	9,639,000	
日本エンタープライズ	18,200	138.00	2,511,600	
WOWOW	10,300	1,268.00	13,060,400	
スカラ	18,100	721.00	13,050,100	
インテリジェント ウェイブ	8,800	710.00	6,248,000	
WOW WORLD GROUP	3,000	1,497.00	4,491,000	
IMAGICA GROUP	15,400	616.00	9,486,400	
ネットワンシステムズ	67,200	3,305.00	222,096,000	
システムソフト	65,100	86.00	5,598,600	
アルゴグラフィックス	16,600	3,830.00	63,578,000	
マーベラス	29,600	709.00	20,986,400	
エイベックス	30,700	1,622.00	49,795,400	
B I P R O G Y	66,400	2,945.00	195,548,000	
兼松エレクトロニクス	11,600	6,180.00	71,688,000	
都築電気	9,700	1,336.00	12,959,200	
T B S ホールディングス	92,400	1,635.00	151,074,000	
日本テレビホールディングス	159,800	1,099.00	175,620,200	
朝日放送グループホールディングス	17,200	672.00	11,558,400	
テレビ朝日ホールディングス	43,900	1,423.00	62,469,700	
スカパー J S A T ホールディングス	160,300	494.00	79,188,200	
テレビ東京ホールディングス	13,100	2,165.00	28,361,500	
日本BS放送	6,000	919.00	5,514,000	
ビジョン	23,900	1,532.00	36,614,800	
スマートバリュー	4,400	426.00	1,874,400	
USEN-NEXT HOLDINGS	16,300	2,506.00	40,847,800	
ワイヤレスゲート	7,800	268.00	2,090,400	
クロップス	2,800	1,150.00	3,220,000	
日本電信電話	2,309,900	3,888.00	8,980,891,200	
K D D I	1,393,000	3,991.00	5,559,463,000	
ソフトバンク	2,896,000	1,527.00	4,422,192,000	
光通信	21,200	20,290.00	430,148,000	
エムティーアイ	16,900	507.00	8,568,300	

GMOインターネットグループ	67,100	2,582.00	173,252,200	
ファイバーゲート	9,900	875.00	8,662,500	
アイドママーケティングコミュニケーション	4,400	287.00	1,262,800	
KADOKAWA	95,400	2,754.00	262,731,600	
学研ホールディングス	30,200	860.00	25,972,000	
ゼンリン	31,100	855.00	26,590,500	
昭文社ホールディングス	7,600	295.00	2,242,000	
インプレスホールディングス	15,100	200.00	3,020,000	
アイネット	11,100	1,272.00	14,119,200	
松竹	10,300	10,910.00	112,373,000	
東宝	112,900	4,770.00	538,533,000	
東映	5,000	17,060.00	85,300,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	565,700	1,876.00	1,061,253,200	
ピー・シー・エー	11,000	1,246.00	13,706,000	
ビジネスブレイン太田昭和	7,800	2,092.00	16,317,600	
D T S	38,500	3,105.00	119,542,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	90,600	6,350.00	575,310,000	
シーイーシー	25,400	1,505.00	38,227,000	
カプコン	179,200	4,540.00	813,568,000	
アイ・エス・ピー	9,400	1,168.00	10,979,200	
ジャステック	11,200	1,232.00	13,798,400	
S C S K	147,200	1,925.00	283,360,000	
N S W	7,100	2,095.00	14,874,500	
アイネス	12,800	1,330.00	17,024,000	
T K C	32,400	3,625.00	117,450,000	
富士ソフト	20,400	7,770.00	158,508,000	
N S D	64,400	2,274.00	146,445,600	
コナミグループ	77,200	6,400.00	494,080,000	
福井コンピュータホールディングス	12,600	2,819.00	35,519,400	
J B C Cホールディングス	13,300	1,918.00	25,509,400	
ミロク情報サービス	16,500	1,766.00	29,139,000	
ソフトバンクグループ	1,042,300	5,764.00	6,007,817,200	
高千穂交易	6,000	2,382.00	14,292,000	
オルパヘルスケアホールディングス	2,600	1,606.00	4,175,600	
伊藤忠食品	4,300	4,970.00	21,371,000	
エレマテック	17,100	1,746.00	29,856,600	

あらた	14,600	3,980.00	58,108,000
トーメンデバイス	2,800	6,780.00	18,984,000
東京エレクトロン デバイス	7,000	7,990.00	55,930,000
円谷フィールズホールディングス	16,300	4,040.00	65,852,000
双日	201,900	2,583.00	521,507,700
アルフレッサ ホールディングス	190,900	1,615.00	308,303,500
横浜冷凍	51,800	994.00	51,489,200
ラサ商事	7,800	1,373.00	10,709,400
アルコニックス	25,000	1,336.00	33,400,000
神戸物産	147,100	3,600.00	529,560,000
ハイパー	3,300	445.00	1,468,500
あい ホールディングス	30,500	2,114.00	64,477,000
ディーブイエックス	4,700	1,027.00	4,826,900
ダイワボウホールディングス	77,700	2,041.00	158,585,700
マクニカホールディングス	46,600	3,495.00	162,867,000
ラクト・ジャパン	7,400	2,000.00	14,800,000
グリムス	7,900	2,536.00	20,034,400
バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,800	850.00	23,630,000
八洲電機	15,400	1,119.00	17,232,600
メディアスホールディングス	12,200	754.00	9,198,800
レスターホールディングス	18,200	2,210.00	40,222,000
ジューテックホールディングス	3,900	1,224.00	4,773,600
大光	6,600	656.00	4,329,600
OCHIホールディングス	3,900	1,313.00	5,120,700
TOKAIホールディングス	93,900	858.00	80,566,200
黒谷	4,700	598.00	2,810,600
C o m i n i x	3,400	767.00	2,607,800
三洋貿易	19,500	1,120.00	21,840,000
ビューティガレージ	3,400	3,775.00	12,835,000
ウイン・パートナーズ	13,900	1,049.00	14,581,100
ミタチ産業	4,300	1,328.00	5,710,400
シップヘルスケアホールディングス	68,400	2,465.00	168,606,000
明治電機工業	7,100	1,121.00	7,959,100
デリカフーズホールディングス	6,700	527.00	3,530,900
スターティアホールディングス	3,300	1,005.00	3,316,500
コメダホールディングス	46,600	2,330.00	108,578,000

ピーバンドットコム	2,500	532.00	1,330,000	
アセンテック	6,500	518.00	3,367,000	
富士興産	3,800	1,238.00	4,704,400	
協栄産業	1,600	1,776.00	2,841,600	
フルサト・マルカホールディングス	18,900	2,879.00	54,413,100	
ヤマエグループホールディングス	10,800	1,582.00	17,085,600	
小野建	17,500	1,488.00	26,040,000	
南陽	3,200	1,982.00	6,342,400	
佐鳥電機	10,700	1,470.00	15,729,000	
エコートレーディング	3,300	812.00	2,679,600	
伯東	10,900	4,855.00	52,919,500	
コンドーテック	14,700	1,045.00	15,361,500	
中山福	9,100	340.00	3,094,000	
ナガイレーベン	24,000	1,953.00	46,872,000	
三菱食品	17,600	3,335.00	58,696,000	
松田産業	14,500	2,234.00	32,393,000	
第一興商	36,800	4,190.00	154,192,000	
メディパルホールディングス	197,300	1,729.00	341,131,700	
S P K	8,500	1,523.00	12,945,500	
萩原電気ホールディングス	7,300	2,665.00	19,454,500	
アズワン	27,800	5,720.00	159,016,000	
スズデン	6,700	2,602.00	17,433,400	
尾家産業	4,000	1,006.00	4,024,000	
シモジマ	13,100	994.00	13,021,400	
ドウシシャ	20,100	1,768.00	35,536,800	
小津産業	3,800	1,664.00	6,323,200	
高速	9,900	1,902.00	18,829,800	
たけびし	7,300	1,601.00	11,687,300	
リックス	3,500	2,511.00	8,788,500	
丸文	17,000	1,337.00	22,729,000	
ハビネット	16,200	1,861.00	30,148,200	
橋本総業ホールディングス	7,600	1,104.00	8,390,400	
日本ライフライン	55,800	907.00	50,610,600	
タカショー	16,600	681.00	11,304,600	
I D O M	57,500	857.00	49,277,500	
進和	12,600	2,094.00	26,384,400	

エスケイジャパン	4,200	564.00	2,368,800	
ダイトロン	7,500	2,449.00	18,367,500	
シークス	27,100	1,522.00	41,246,200	
田中商事	4,800	592.00	2,841,600	
オーハシテクニカ	9,600	1,533.00	14,716,800	
白銅	6,900	2,566.00	17,705,400	
ダイコー通産	1,900	1,081.00	2,053,900	
伊藤忠商事	1,171,800	4,135.00	4,845,393,000	
丸紅	1,501,300	1,755.00	2,634,781,500	
高島	2,700	2,894.00	7,813,800	
長瀬産業	89,400	2,037.00	182,107,800	
蝶理	10,200	2,486.00	25,357,200	
豊田通商	166,600	5,600.00	932,960,000	
三共生興	27,400	525.00	14,385,000	
兼松	73,800	1,579.00	116,530,200	
ツカモトコーポレーション	2,400	1,400.00	3,360,000	
三井物産	1,391,500	3,950.00	5,496,425,000	
日本紙パルプ商事	10,100	5,070.00	51,207,000	
カメイ	20,200	1,333.00	26,926,600	
東都水産	900	5,720.00	5,148,000	
OUGホールディングス	2,500	2,473.00	6,182,500	
スターゼン	14,500	2,146.00	31,117,000	
山善	51,300	1,036.00	53,146,800	
椿本興業	3,100	4,080.00	12,648,000	
住友商事	1,177,700	2,361.00	2,780,549,700	
内田洋行	8,400	4,645.00	39,018,000	
三菱商事	1,189,000	4,696.00	5,583,544,000	
第一実業	6,700	5,180.00	34,706,000	
キャノンマーケティングジャパン	44,100	3,080.00	135,828,000	
西華産業	7,500	1,691.00	12,682,500	
佐藤商事	13,200	1,326.00	17,503,200	
菱洋エレクトロ	16,200	2,441.00	39,544,200	
東京産業	17,400	775.00	13,485,000	
ユアサ商事	17,100	3,630.00	62,073,000	
神鋼商事	4,800	5,700.00	27,360,000	
トルク	9,300	209.00	1,943,700	

阪和興業	34,200	3,960.00	135,432,000
正栄食品工業	12,700	4,175.00	53,022,500
カナデン	15,400	1,106.00	17,032,400
菱電商事	15,400	1,850.00	28,490,000
岩谷産業	43,300	5,670.00	245,511,000
ナイス	4,600	1,356.00	6,237,600
ニチモウ	2,000	3,275.00	6,550,000
極東貿易	11,400	1,436.00	16,370,400
アステナホールディングス	33,000	424.00	13,992,000
三愛オブリ	52,500	1,422.00	74,655,000
稲畑産業	38,400	2,572.00	98,764,800
G S I クレオス	11,100	1,548.00	17,182,800
明和産業	25,300	693.00	17,532,900
クワザワホールディングス	5,500	465.00	2,557,500
ワキタ	35,000	1,159.00	40,565,000
東邦ホールディングス	47,400	2,111.00	100,061,400
サンゲツ	47,800	2,346.00	112,138,800
ミツウロコグループホールディングス	24,500	1,361.00	33,344,500
シナネンホールディングス	6,200	3,530.00	21,886,000
伊藤忠エネクス	47,200	1,094.00	51,636,800
サンリオ	53,900	4,005.00	215,869,500
サンワテクノス	9,700	1,924.00	18,662,800
リョーサン	20,200	3,075.00	62,115,000
新光商事	25,600	1,286.00	32,921,600
トーヨー	8,200	1,758.00	14,415,600
三信電気	7,700	2,556.00	19,681,200
東陽テクニカ	21,100	1,292.00	27,261,200
モスフードサービス	28,000	3,095.00	86,660,000
加賀電子	15,400	4,635.00	71,379,000
ソーダニッカ	12,400	754.00	9,349,600
立花エレテック	13,900	1,863.00	25,895,700
フォーバル	7,500	1,007.00	7,552,500
PAL TAC	29,900	4,755.00	142,174,500
三谷産業	33,400	315.00	10,521,000
西本Wismettacホールディングス	4,800	3,605.00	17,304,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,400	1,782.00	2,494,800

コーア商事ホールディングス	13,400	633.00	8,482,200	
K P P グループホールディングス	44,400	760.00	33,744,000	
ヤマタネ	8,400	1,660.00	13,944,000	
丸紅建材リース	1,500	1,935.00	2,902,500	
日鉄物産	13,000	9,260.00	120,380,000	
泉州電業	9,500	3,640.00	34,580,000	
トラスコ中山	40,000	2,235.00	89,400,000	
オートボックスセブン	66,200	1,437.00	95,129,400	
モリト	13,700	960.00	13,152,000	
加藤産業	23,100	3,665.00	84,661,500	
北恵	3,800	698.00	2,652,400	
イエローハット	33,600	1,755.00	58,968,000	
J K ホールディングス	15,000	1,024.00	15,360,000	
日伝	11,300	1,913.00	21,616,900	
北沢産業	9,200	270.00	2,484,000	
杉本商事	8,500	1,922.00	16,337,000	
因幡電機産業	49,300	2,789.00	137,497,700	
東テク	6,400	4,120.00	26,368,000	
ミスミグループ本社	286,900	3,150.00	903,735,000	
アルテック	9,500	266.00	2,527,000	
タキヒヨー	4,100	969.00	3,972,900	
蔵王産業	2,800	1,961.00	5,490,800	
スズケン	59,200	3,420.00	202,464,000	
ジェコス	12,300	854.00	10,504,200	
グローセル	20,400	412.00	8,404,800	
ローソン	47,200	5,380.00	253,936,000	
サンエー	14,600	4,130.00	60,298,000	
カワチ薬品	15,000	2,331.00	34,965,000	
エービーシー・マート	27,800	6,750.00	187,650,000	
ハードオフコーポレーション	7,000	1,293.00	9,051,000	
アスクル	39,500	1,717.00	67,821,500	
ゲオホールディングス	20,200	1,776.00	35,875,200	
アダストリア	23,100	2,219.00	51,258,900	
くら寿司	22,400	3,205.00	71,792,000	
キャンドウ	6,900	2,310.00	15,939,000	
I K ホールディングス	6,200	366.00	2,269,200	

パルグループホールディングス	18,800	2,760.00	51,888,000	
エディオン	75,500	1,314.00	99,207,000	
サーラコーポレーション	40,400	708.00	28,603,200	
ワッツ	8,700	686.00	5,968,200	
ハローズ	8,700	3,340.00	29,058,000	
あみやき亭	4,700	2,956.00	13,893,200	
大黒天物産	6,900	4,855.00	33,499,500	
ハニーズホールディングス	17,100	1,455.00	24,880,500	
ファーマライズホールディングス	4,200	615.00	2,583,000	
アルペン	15,900	1,936.00	30,782,400	
ハブ	6,000	721.00	4,326,000	
クオールホールディングス	26,400	1,177.00	31,072,800	
ジーンズホールディングス	11,400	3,650.00	41,610,000	
ビックカメラ	126,700	1,184.00	150,012,800	
DCMホールディングス	116,400	1,180.00	137,352,000	
Monotaro	269,700	1,908.00	514,587,600	
東京一番フーズ	4,500	492.00	2,214,000	
きちりホールディングス	4,000	583.00	2,332,000	
アークランドサービスホールディングス	15,700	2,188.00	34,351,600	
J. フロント リテイリング	236,700	1,247.00	295,164,900	
ドトール・日レスホールディングス	33,900	1,876.00	63,596,400	
マツキヨココカラ&カンパニー	115,400	6,610.00	762,794,000	
ブロンコビリー	10,300	2,410.00	24,823,000	
ZOZO	125,800	3,035.00	381,803,000	
トレジャー・ファクトリー	5,300	2,800.00	14,840,000	
物語コーポレーション	10,600	7,070.00	74,942,000	
三越伊勢丹ホールディングス	320,300	1,380.00	442,014,000	
Hamee	8,100	814.00	6,593,400	
マーケットエンタープライズ	2,000	1,001.00	2,002,000	
ウエルシアホールディングス	98,800	3,015.00	297,882,000	
クリエイトSDホールディングス	31,500	3,410.00	107,415,000	
丸善CHIホールディングス	20,800	349.00	7,259,200	
ミサワ	3,500	612.00	2,142,000	
ティーライフ	2,500	1,265.00	3,162,500	
チムニー	5,200	1,153.00	5,995,600	
シュッピン	14,400	892.00	12,844,800	

オイシックス・ラ・大地	25,700	2,463.00	63,299,100
ネクステージ	43,500	3,160.00	137,460,000
ジョイフル本田	61,300	1,755.00	107,581,500
鳥貴族ホールディングス	7,200	2,071.00	14,911,200
ホットランド	14,800	1,382.00	20,453,600
すかいらーくホールディングス	260,200	1,585.00	412,417,000
SFPホールディングス	10,400	1,773.00	18,439,200
綿半ホールディングス	14,900	1,404.00	20,919,600
ヨシックスホールディングス	3,500	2,102.00	7,357,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	62,300	1,127.00	70,212,100
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,800	978.00	8,606,400
B E E N O S	10,900	2,417.00	26,345,300
あさひ	16,100	1,348.00	21,702,800
日本調剤	13,200	1,174.00	15,496,800
コスモス薬品	18,800	12,580.00	236,504,000
トーエル	7,900	775.00	6,122,500
セブン&アイ・ホールディングス	655,400	6,083.00	3,986,798,200
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	143,000	975.00	139,425,000
ツルハホールディングス	40,000	9,410.00	376,400,000
サンマルクホールディングス	15,500	1,775.00	27,512,500
フェリシモ	4,100	1,003.00	4,112,300
トリドールホールディングス	47,400	2,731.00	129,449,400
TOKYO BASE	20,500	441.00	9,040,500
ウイルプラスホールディングス	3,000	1,157.00	3,471,000
JMホールディングス	16,300	1,812.00	29,535,600
サツドラホールディングス	8,100	785.00	6,358,500
アレンザホールディングス	14,500	1,008.00	14,616,000
串カツ田中ホールディングス	5,300	1,605.00	8,506,500
バロックジャパンリミテッド	12,700	835.00	10,604,500
クスリのアオキホールディングス	17,000	7,010.00	119,170,000
力の源ホールディングス	9,700	1,434.00	13,909,800
FOOD & LIFE COMPANIES	109,300	3,545.00	387,468,500
メディカルシステムネットワーク	17,300	399.00	6,902,700
はるやまホールディングス	7,800	442.00	3,447,600
ノジマ	62,300	1,313.00	81,799,900

カップ・クリエイト	29,900	1,428.00	42,697,200
ライトオン	12,800	553.00	7,078,400
良品計画	245,600	1,396.00	342,857,600
パリミキホールディングス	22,200	277.00	6,149,400
アドヴァングループ	18,500	895.00	16,557,500
アルビス	6,400	2,408.00	15,411,200
コナカ	18,400	354.00	6,513,600
ハウス オブ ローゼ	2,300	1,641.00	3,774,300
G-7ホールディングス	23,900	1,444.00	34,511,600
イオン北海道	28,300	890.00	25,187,000
コジマ	37,200	559.00	20,794,800
ヒマラヤ	5,600	941.00	5,269,600
コーナン商事	25,700	3,325.00	85,452,500
エコス	7,200	1,856.00	13,363,200
ワタミ	23,000	899.00	20,677,000
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	384,000	2,553.00	980,352,000
西松屋チェーン	42,300	1,558.00	65,903,400
ゼンショーホールディングス	104,200	3,680.00	383,456,000
幸楽苑ホールディングス	12,400	1,060.00	13,144,000
ハークスレイ	6,300	713.00	4,491,900
サイゼリヤ	31,700	3,095.00	98,111,500
VTホールディングス	72,900	503.00	36,668,700
魚力	6,000	2,155.00	12,930,000
フジ・コーポレーション	11,000	1,257.00	13,827,000
ユナイテッドアローズ	20,500	1,734.00	35,547,000
ハイデイ日高	28,400	2,040.00	57,936,000
YU-WA Creation Holdings	11,600	200.00	2,320,000
コロワイド	87,600	1,873.00	164,074,800
ピーシーデポコーポレーション	22,400	292.00	6,540,800
壺番屋	15,100	4,680.00	70,668,000
PLANT	4,400	660.00	2,904,000
スギホールディングス	38,400	5,680.00	218,112,000
薬王堂ホールディングス	10,700	2,435.00	26,054,500
スクロール	28,700	769.00	22,070,300
ヨンドシーホールディングス	16,500	1,793.00	29,584,500

木曾路	28,900	2,166.00	62,597,400	
S R S ホールディングス	31,700	912.00	28,910,400	
千趣会	35,800	395.00	14,141,000	
リテールパートナーズ	28,500	1,338.00	38,133,000	
ケーヨー	30,900	893.00	27,593,700	
上新電機	17,100	1,970.00	33,687,000	
日本瓦斯	102,000	1,866.00	190,332,000	
ロイヤルホールディングス	36,900	2,527.00	93,246,300	
いなげや	18,600	1,316.00	24,477,600	
チヨダ	18,600	791.00	14,712,600	
ライフコーポレーション	16,700	2,770.00	46,259,000	
リンガーハット	24,500	2,253.00	55,198,500	
M r M a x H D	27,100	681.00	18,455,100	
A O K I ホールディングス	35,800	766.00	27,422,800	
オークワ	30,600	897.00	27,448,200	
コメリ	29,400	2,635.00	77,469,000	
青山商事	41,000	932.00	38,212,000	
しまむら	22,400	12,650.00	283,360,000	
はせがわ	8,900	331.00	2,945,900	
高島屋	143,500	1,862.00	267,197,000	
松屋	32,400	1,135.00	36,774,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	92,700	1,322.00	122,549,400	
近鉄百貨店	6,200	2,454.00	15,214,800	
丸井グループ	140,300	2,055.00	288,316,500	
アクシアル リテイリング	13,100	3,520.00	46,112,000	
イオン	644,700	2,614.00	1,685,245,800	
イズミ	29,000	3,005.00	87,145,000	
平和堂	31,900	2,156.00	68,776,400	
フジ	29,300	1,828.00	53,560,400	
ヤオコー	21,500	6,790.00	145,985,000	
ゼビオホールディングス	26,100	956.00	24,951,600	
ケーズホールディングス	151,500	1,174.00	177,861,000	
O l y m p i c グループ	6,900	522.00	3,601,800	
日産東京販売ホールディングス	22,500	340.00	7,650,000	
シルバーライフ	4,600	1,816.00	8,353,600	
G e n k y D r u g S t o r e s	9,500	4,230.00	40,185,000	

ナルミヤ・インターナショナル	3,100	924.00	2,864,400
ブックオフグループホールディングス	11,300	1,282.00	14,486,600
ギフトホールディングス	4,100	4,175.00	17,117,500
アインホールディングス	26,300	5,610.00	147,543,000
元気寿司	6,100	3,010.00	18,361,000
ヤマダホールディングス	780,500	479.00	373,859,500
アーケランズ	28,000	1,452.00	40,656,000
ニトリホールディングス	76,900	16,065.00	1,235,398,500
グルメ杵屋	15,700	1,009.00	15,841,300
愛眼	12,500	165.00	2,062,500
ケーユーホールディングス	11,400	1,444.00	16,461,600
吉野家ホールディングス	74,600	2,376.00	177,249,600
松屋フーズホールディングス	9,100	3,985.00	36,263,500
サガミホールディングス	30,800	1,262.00	38,869,600
関西フードマーケット	17,400	1,349.00	23,472,600
王将フードサービス	12,600	6,040.00	76,104,000
ミニストップ	14,000	1,408.00	19,712,000
アークス	35,000	2,210.00	77,350,000
バローホールディングス	36,500	1,927.00	70,335,500
ベルク	9,500	5,500.00	52,250,000
大庄	9,400	1,036.00	9,738,400
ファーストリテイリング	28,500	82,890.00	2,362,365,000
サンドラッグ	72,300	3,660.00	264,618,000
サックスパー ホールディングス	18,500	763.00	14,115,500
ヤマザワ	3,300	1,474.00	4,864,200
やまや	3,600	2,607.00	9,385,200
ベルーナ	46,200	683.00	31,554,600
いよぎんホールディングス	210,700	798.00	168,138,600
しずおかフィナンシャルグループ	400,000	1,098.00	439,200,000
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	149,000	960.00	143,040,000
島根銀行	5,400	517.00	2,791,800
じもとホールディングス	10,400	434.00	4,513,600
めぶきフィナンシャルグループ	878,400	363.00	318,859,200
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,700	2,976.00	67,555,200
九州フィナンシャルグループ	311,500	508.00	158,242,000
ゆうちょ銀行	504,000	1,201.00	605,304,000

富山第一銀行	44,100	642.00	28,312,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	975,600	574.00	559,994,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	112,100	1,121.00	125,664,100	
三十三フィナンシャルグループ	15,800	1,700.00	26,860,000	
第四北越フィナンシャルグループ	27,800	3,205.00	89,099,000	
ひろぎんホールディングス	231,000	686.00	158,466,000	
おきなわフィナンシャルグループ	16,900	2,345.00	39,630,500	
十六フィナンシャルグループ	22,900	3,170.00	72,593,000	
北國フィナンシャルホールディングス	14,900	4,245.00	63,250,500	
プロクレアホールディングス	21,700	2,353.00	51,060,100	
あいちフィナンシャルグループ	24,800	2,344.00	58,131,200	
S B I 新生銀行	52,200	2,414.00	126,010,800	
あおぞら銀行	111,300	2,632.00	292,941,600	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,239,500	981.00	11,025,949,500	
りそなホールディングス	2,259,300	734.50	1,659,455,850	
三井住友トラスト・ホールディングス	321,700	4,885.00	1,571,504,500	
三井住友フィナンシャルグループ	1,293,600	5,924.00	7,663,286,400	
千葉銀行	493,300	985.00	485,900,500	
群馬銀行	343,500	501.00	172,093,500	
武蔵野銀行	22,700	2,485.00	56,409,500	
千葉興業銀行	36,800	511.00	18,804,800	
筑波銀行	77,700	233.00	18,104,100	
七十七銀行	56,700	2,393.00	135,683,100	
秋田銀行	11,900	1,930.00	22,967,000	
山形銀行	19,700	1,278.00	25,176,600	
岩手銀行	12,100	2,404.00	29,088,400	
東邦銀行	140,000	248.00	34,720,000	
東北銀行	7,700	1,024.00	7,884,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	141,300	3,050.00	430,965,000	
スルガ銀行	156,000	422.00	65,832,000	
八十二銀行	363,100	596.00	216,407,600	
山梨中央銀行	18,200	1,332.00	24,242,400	
大垣共立銀行	33,700	1,978.00	66,658,600	
福井銀行	15,800	1,681.00	26,559,800	
清水銀行	7,000	1,538.00	10,766,000	
富山銀行	2,400	1,764.00	4,233,600	

滋賀銀行	29,400	2,879.00	84,642,600	
南都銀行	26,600	2,648.00	70,436,800	
百五銀行	166,500	415.00	69,097,500	
京都銀行	56,100	6,370.00	357,357,000	
紀陽銀行	63,300	1,616.00	102,292,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	112,500	1,032.00	116,100,000	
山陰合同銀行	110,800	831.00	92,074,800	
鳥取銀行	5,000	1,255.00	6,275,000	
百十四銀行	16,100	1,965.00	31,636,500	
四国銀行	28,100	940.00	26,414,000	
阿波銀行	26,200	2,208.00	57,849,600	
大分銀行	10,600	2,248.00	23,828,800	
宮崎銀行	11,600	2,750.00	31,900,000	
佐賀銀行	10,400	1,827.00	19,000,800	
琉球銀行	40,600	1,079.00	43,807,400	
セブン銀行	634,100	267.00	169,304,700	
みずほフィナンシャルグループ	2,560,100	2,129.50	5,451,732,950	
高知銀行	5,400	732.00	3,952,800	
山口フィナンシャルグループ	195,500	915.00	178,882,500	
長野銀行	4,900	1,509.00	7,394,100	
名古屋銀行	11,700	3,620.00	42,354,000	
北洋銀行	268,200	297.00	79,655,400	
大光銀行	4,700	1,239.00	5,823,300	
愛媛銀行	23,900	948.00	22,657,200	
トマト銀行	5,200	1,085.00	5,642,000	
京葉銀行	82,200	646.00	53,101,200	
栃木銀行	81,000	326.00	26,406,000	
北日本銀行	6,200	2,147.00	13,311,400	
東和銀行	32,500	603.00	19,597,500	
福島銀行	16,600	244.00	4,050,400	
大東銀行	6,100	725.00	4,422,500	
トモニホールディングス	143,100	382.00	54,664,200	
フィデアホールディングス	18,300	1,459.00	26,699,700	
池田泉州ホールディングス	226,700	251.00	56,901,700	
F P G	72,100	1,180.00	85,078,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,700	1,050.00	15,435,000	

マーキュリアホールディングス	9,500	794.00	7,543,000	
S B I ホールディングス	256,300	2,871.00	735,837,300	
ジャフコ グループ	59,200	2,139.00	126,628,800	
大和証券グループ本社	1,266,200	626.00	792,641,200	
野村ホールディングス	3,260,500	548.10	1,787,080,050	
岡三証券グループ	156,000	443.00	69,108,000	
丸三証券	59,400	427.00	25,363,800	
東洋証券	59,500	324.00	19,278,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	193,300	381.00	73,647,300	
光世証券	4,100	365.00	1,496,500	
水戸証券	48,300	298.00	14,393,400	
いちよし証券	33,000	634.00	20,922,000	
松井証券	104,900	794.00	83,290,600	
マネックスグループ	198,200	513.00	101,676,600	
極東証券	22,400	617.00	13,820,800	
岩井コスモホールディングス	20,300	1,346.00	27,323,800	
アイザワ証券グループ	25,900	697.00	18,052,300	
マネーパートナーズグループ	17,200	256.00	4,403,200	
スパークス・グループ	19,900	1,747.00	34,765,300	
かんぽ生命保険	214,900	2,364.00	508,023,600	
S O M P O ホールディングス	303,800	5,641.00	1,713,735,800	
アニコム ホールディングス	60,100	537.00	32,273,700	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	360,200	4,390.00	1,581,278,000	
第一生命ホールディングス	901,100	2,988.00	2,692,486,800	
東京海上ホールディングス	1,782,500	2,827.50	5,040,018,750	
T&Dホールディングス	475,100	2,129.00	1,011,487,900	
アドバンスクリエイト	10,200	1,202.00	12,260,400	
全国保証	46,400	5,180.00	240,352,000	
あんしん保証	9,600	265.00	2,544,000	
イントラスト	6,600	925.00	6,105,000	
日本モーゲージサービス	9,300	884.00	8,221,200	
C a s a	6,600	818.00	5,398,800	
アルヒ	22,400	1,101.00	24,662,400	
プレミアグループ	30,100	1,564.00	47,076,400	
ネットプロテクションズホールディングス	59,400	584.00	34,689,600	

クレディセゾン	112,500	1,792.00	201,600,000
芙蓉総合リース	16,400	8,990.00	147,436,000
みずほリース	26,500	3,560.00	94,340,000
東京センチュリー	33,200	4,570.00	151,724,000
日本証券金融	71,500	1,009.00	72,143,500
アイフル	294,600	360.00	106,056,000
リコーリース	16,900	3,915.00	66,163,500
イオンフィナンシャルサービス	102,100	1,318.00	134,567,800
アコム	317,700	322.00	102,299,400
ジャックス	19,000	4,230.00	80,370,000
オリエントコーポレーション	46,700	1,156.00	53,985,200
オリックス	1,184,300	2,352.00	2,785,473,600
三菱HCキャピタル	691,000	678.00	468,498,000
九州リースサービス	8,000	878.00	7,024,000
日本取引所グループ	497,700	1,955.00	973,003,500
イー・ギャランティ	28,800	2,220.00	63,936,000
アサックス	8,000	603.00	4,824,000
NECキャピタルソリューション	8,900	2,531.00	22,525,900
大東建託	65,000	12,610.00	819,650,000
いちご	210,200	286.00	60,117,200
日本駐車場開発	218,200	257.00	56,077,400
スター・マイカ・ホールディングス	18,700	666.00	12,454,200
SREホールディングス	9,200	3,440.00	31,648,000
ADワークスグループ	39,600	160.00	6,336,000
ヒューリック	414,800	1,074.00	445,495,200
三栄建築設計	9,800	1,480.00	14,504,000
野村不動産ホールディングス	111,300	2,897.00	322,436,100
三重交通グループホールディングス	41,800	498.00	20,816,400
サムティ	29,100	2,032.00	59,131,200
ディア・ライフ	30,200	620.00	18,724,000
地主	14,600	1,889.00	27,579,400
プレサンスコーポレーション	24,500	1,689.00	41,380,500
ハウスコム	4,200	1,117.00	4,691,400
JPMC	10,800	999.00	10,789,200
サンセイランディック	6,900	818.00	5,644,200
フージャースホールディングス	27,300	813.00	22,194,900

オープンハウスグループ	65,200	4,860.00	316,872,000
東急不動産ホールディングス	535,300	635.00	339,915,500
飯田グループホールディングス	156,000	2,174.00	339,144,000
イーグランド	3,600	1,519.00	5,468,400
ムゲンエステート	14,300	513.00	7,335,900
And Doホールディングス	10,500	880.00	9,240,000
シーアールイー	9,700	1,070.00	10,379,000
ケイアイスター不動産	8,900	4,060.00	36,134,000
グッドコムアセット	18,800	831.00	15,622,800
ジェイ・エス・ビー	4,800	3,870.00	18,576,000
ロードスターキャピタル	8,700	1,515.00	13,180,500
テンポイノベーション	6,500	1,190.00	7,735,000
フェイスネットワーク	3,500	1,681.00	5,883,500
パーク24	138,800	2,016.00	279,820,800
パラカ	7,200	1,930.00	13,896,000
三井不動産	770,100	2,457.00	1,892,135,700
三菱地所	1,069,300	1,622.00	1,734,404,600
平和不動産	29,300	3,585.00	105,040,500
東京建物	169,900	1,580.00	268,442,000
京阪神ビルディング	23,700	1,227.00	29,079,900
住友不動産	320,600	3,080.00	987,448,000
テーオーシー	34,800	623.00	21,680,400
東京楽天地	3,500	4,400.00	15,400,000
スターツコーポレーション	26,200	2,552.00	66,862,400
フジ住宅	27,600	673.00	18,574,800
空港施設	24,900	516.00	12,848,400
明和地所	10,300	923.00	9,506,900
ゴールドクレスト	18,000	1,660.00	29,880,000
エスリード	9,300	2,098.00	19,511,400
日神グループホールディングス	32,700	449.00	14,682,300
日本エスコン	39,800	824.00	32,795,200
MIRARTHホールディングス	89,500	360.00	32,220,000
AVANTIA	10,400	797.00	8,288,800
イオンモール	92,800	1,791.00	166,204,800
毎日コムネット	8,600	711.00	6,114,600
ファースト住建	8,200	1,070.00	8,774,000

カチタス	48,200	2,581.00	124,404,200	
トーセイ	30,800	1,435.00	44,198,000	
穴吹興産	4,000	2,187.00	8,748,000	
サンフロンティア不動産	31,200	1,184.00	36,940,800	
F J ネクストホールディングス	20,600	974.00	20,064,400	
インテリックス	3,800	573.00	2,177,400	
ランドビジネス	5,800	225.00	1,305,000	
サンネクスタグループ	6,700	979.00	6,559,300	
グランディハウス	16,500	570.00	9,405,000	
日本空港ビルデング	62,900	6,400.00	402,560,000	
明豊ファシリティワークス	8,700	801.00	6,968,700	
日本工営	13,300	3,255.00	43,291,500	
L I F U L L	64,700	192.00	12,422,400	
M I X I	42,200	2,592.00	109,382,400	
ジェイエイシーリクルートメント	16,800	2,261.00	37,984,800	
日本M&Aセンターホールディングス	317,200	1,193.00	378,419,600	
メンバーズ	5,600	1,526.00	8,545,600	
中広	3,100	397.00	1,230,700	
UTグループ	27,300	2,344.00	63,991,200	
アイティメディア	7,200	1,485.00	10,692,000	
E・Jホールディングス	12,100	1,330.00	16,093,000	
オープンアップグループ	55,500	1,906.00	105,783,000	
コシダカホールディングス	55,700	908.00	50,575,600	
アルトナー	4,300	1,069.00	4,596,700	
パソナグループ	22,600	1,924.00	43,482,400	
C D S	4,300	1,788.00	7,688,400	
リンクアンドモチベーション	53,200	595.00	31,654,000	
エス・エム・エス	70,400	3,340.00	235,136,000	
サニーサイドアップグループ	5,500	562.00	3,091,000	
パーソルホールディングス	206,900	2,772.00	573,526,800	
リニカル	9,800	710.00	6,958,000	
クックパッド	52,000	221.00	11,492,000	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	8,600	640.00	5,504,000	
学情	8,600	1,389.00	11,945,400	
スタジオアリス	9,400	2,110.00	19,834,000	
シミックホールディングス	10,400	1,771.00	18,418,400	

エプロ	3,900	713.00	2,780,700	
N J S	4,200	2,191.00	9,202,200	
総合警備保障	68,700	3,530.00	242,511,000	
カカコム	138,100	1,954.00	269,847,400	
アイロムグループ	6,800	2,024.00	13,763,200	
セントケア・ホールディング	12,200	783.00	9,552,600	
サイネックス	3,300	555.00	1,831,500	
ルネサンス	13,300	894.00	11,890,200	
ディップ	32,400	3,720.00	120,528,000	
デジタルホールディングス	14,700	1,190.00	17,493,000	
新日本科学	19,700	2,658.00	52,362,600	
キャリアデザインセンター	3,600	1,957.00	7,045,200	
ベネフィット・ワン	85,800	2,129.00	182,668,200	
エムスリー	365,200	3,348.00	1,222,689,600	
ツカダ・グローバルホールディング	10,500	399.00	4,189,500	
アウトソーシング	110,400	1,225.00	135,240,000	
ウェルネット	13,100	679.00	8,894,900	
ワールドホールディングス	8,400	2,676.00	22,478,400	
ディー・エヌ・エー	79,000	1,786.00	141,094,000	
博報堂DYホールディングス	235,900	1,495.00	352,670,500	
ぐるなび	34,800	367.00	12,771,600	
タカミヤ	25,900	416.00	10,774,400	
ジャパンベストレスキューシステム	11,500	784.00	9,016,000	
ファンコミュニケーションズ	37,000	411.00	15,207,000	
ライク	7,000	1,912.00	13,384,000	
ビジネス・ブレークスルー	7,000	373.00	2,611,000	
エスプール	53,600	679.00	36,394,400	
WDBホールディングス	9,600	2,012.00	19,315,200	
ティア	10,400	425.00	4,420,000	
CDG	2,100	1,162.00	2,440,200	
アドウェイズ	26,100	647.00	16,886,700	
バリューコマース	14,100	1,764.00	24,872,400	
インフォマート	192,600	326.00	62,787,600	
J Pホールディングス	54,100	333.00	18,015,300	
エコナックホールディングス	32,000	90.00	2,880,000	
CLホールディングス	5,500	797.00	4,383,500	

プレステージ・インターナショナル	78,200	682.00	53,332,400	
アミューズ	10,200	1,749.00	17,839,800	
ドリームインキュベータ	5,800	2,772.00	16,077,600	
クイック	14,300	1,840.00	26,312,000	
T A C	9,500	203.00	1,928,500	
電通グループ	181,700	4,320.00	784,944,000	
イオンファンタジー	8,100	2,900.00	23,490,000	
シーティーエス	20,800	785.00	16,328,000	
ネクシィーズグループ	5,600	659.00	3,690,400	
H. U. グループホールディングス	54,200	2,664.00	144,388,800	
アルプス技研	16,200	2,316.00	37,519,200	
日本空調サービス	20,300	713.00	14,473,900	
オリエンタルランド	195,600	21,590.00	4,223,004,000	
ダスキン	41,200	3,080.00	126,896,000	
明光ネットワークジャパン	24,900	617.00	15,363,300	
ファルコホールディングス	8,500	1,952.00	16,592,000	
ラウンドワン	155,300	477.00	74,078,100	
リゾートトラスト	73,100	2,125.00	155,337,500	
ビー・エム・エル	23,000	3,150.00	72,450,000	
りらいあコミュニケーションズ	30,700	1,453.00	44,607,100	
リソー教育	84,900	346.00	29,375,400	
早稲田アカデミー	10,500	1,207.00	12,673,500	
ユー・エス・エス	190,200	2,205.00	419,391,000	
東京個別指導学院	22,500	531.00	11,947,500	
サイバーエージェント	442,400	1,210.00	535,304,000	
楽天グループ	855,500	679.00	580,884,500	
クリーク・アンド・リバー社	11,000	2,271.00	24,981,000	
モーニングスター	30,900	484.00	14,955,600	
テー・オー・ダブリュー	40,700	306.00	12,454,200	
山田コンサルティンググループ	9,700	1,511.00	14,656,700	
セントラルスポーツ	7,100	2,458.00	17,451,800	
フルキャストホールディングス	17,800	2,510.00	44,678,000	
エン・ジャパン	33,600	2,421.00	81,345,600	
リソルホールディングス	1,600	4,895.00	7,832,000	
テクノプロ・ホールディングス	109,400	3,490.00	381,806,000	
アトラグループ	3,700	184.00	680,800	

インターワークス	5,100	376.00	1,917,600	
アイ・アールジャパンホールディングス	9,800	1,990.00	19,502,000	
K e e P e r 技研	13,400	3,505.00	46,967,000	
ファーストロジック	2,900	884.00	2,563,600	
三機サービス	2,800	905.00	2,534,000	
G u n o s y	12,000	637.00	7,644,000	
デザインワン・ジャパン	6,500	191.00	1,241,500	
イー・ガーディアン	7,100	2,360.00	16,756,000	
リブセンス	8,600	263.00	2,261,800	
ジャパンマテリアル	56,700	2,355.00	133,528,500	
ベクトル	29,300	1,331.00	38,998,300	
ウチヤマホールディングス	8,200	268.00	2,197,600	
チャーム・ケア・コーポレーション	15,700	1,070.00	16,799,000	
キャリアリンク	6,900	2,513.00	17,339,700	
I B J	11,600	861.00	9,987,600	
アサンテ	9,300	1,633.00	15,186,900	
バリューHR	16,300	1,733.00	28,247,900	
M&Aキャピタルパートナーズ	17,100	4,390.00	75,069,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,900	1,089.00	7,514,100	
E R I ホールディングス	4,400	1,500.00	6,600,000	
アビスト	2,700	2,970.00	8,019,000	
シグマクシス・ホールディングス	28,300	1,117.00	31,611,100	
ウィルグループ	15,700	1,126.00	17,678,200	
エスクロー・エージェント・ジャパン	19,400	152.00	2,948,800	
メドピア	14,800	1,370.00	20,276,000	
レアジョブ	3,500	1,026.00	3,591,000	
リクルートホールディングス	1,368,000	3,841.00	5,254,488,000	
エラン	24,800	1,066.00	26,436,800	
土木管理総合試験所	7,900	306.00	2,417,400	
日本郵政	2,421,900	1,197.00	2,899,014,300	
ベルシステム24ホールディングス	25,000	1,477.00	36,925,000	
鎌倉新書	21,300	1,105.00	23,536,500	
SMN	4,600	458.00	2,106,800	
グローバルキッズCOMPANY	2,900	788.00	2,285,200	
エアトリ	12,000	2,515.00	30,180,000	
アトラエ	14,800	1,033.00	15,288,400	

ストライク	9,200	4,010.00	36,892,000	
ソラスト	51,400	682.00	35,054,800	
セラク	6,800	1,458.00	9,914,400	
インソース	46,000	1,362.00	62,652,000	
ベイカレント・コンサルティング	146,300	5,550.00	811,965,000	
Orchestra Holdings	4,100	1,891.00	7,753,100	
アイモバイル	9,900	1,230.00	12,177,000	
キャリアインデックス	6,600	321.00	2,118,600	
MS-Japan	5,700	1,115.00	6,355,500	
船場	3,200	745.00	2,384,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	66,000	2,010.00	132,660,000	
フルテック	2,600	1,084.00	2,818,400	
GameWith	5,900	322.00	1,899,800	
MS&Consulting	2,500	554.00	1,385,000	
ウェルビー	14,000	640.00	8,960,000	
エル・ティー・エス	2,500	2,373.00	5,932,500	
ミダックホールディングス	11,300	2,809.00	31,741,700	
日総工産	14,400	642.00	9,244,800	
キュービーネットホールディングス	9,800	1,423.00	13,945,400	
RPAホールディングス	26,100	331.00	8,639,100	
スプリックス	6,000	856.00	5,136,000	
マネジメントソリューションズ	10,300	3,625.00	37,337,500	
プロレド・パートナーズ	5,200	533.00	2,771,600	
テノ.ホールディングス	2,400	998.00	2,395,200	
フロンティア・マネジメント	6,400	1,289.00	8,249,600	
ピアラ	3,300	497.00	1,640,100	
コプロ・ホールディングス	3,000	1,190.00	3,570,000	
ギークス	2,600	1,096.00	2,849,600	
カーブスホールディングス	57,200	783.00	44,787,600	
フォーラムエンジニアリング	11,200	880.00	9,856,000	
Fast Fitness Japan	6,600	1,305.00	8,613,000	
ダイレクトマーケティングミックス	21,500	1,633.00	35,109,500	
ポピンズ	2,900	1,729.00	5,014,100	
LITALICO	14,500	2,569.00	37,250,500	
アドバンテッジリスクマネジメント	8,200	470.00	3,854,000	

リログループ	103,000	2,152.00	221,656,000	
東祥	13,200	1,165.00	15,378,000	
ビーウィズ	5,800	1,488.00	8,630,400	
TREホールディングス	39,100	1,487.00	58,141,700	
人・夢・技術グループ	8,500	1,540.00	13,090,000	
大栄環境	35,400	1,702.00	60,250,800	
エイチ・アイ・エス	48,500	2,081.00	100,928,500	
ラックランド	5,900	2,895.00	17,080,500	
共立メンテナンス	31,700	5,240.00	166,108,000	
イチネンホールディングス	19,800	1,269.00	25,126,200	
建設技術研究所	9,600	3,415.00	32,784,000	
スペース	13,800	881.00	12,157,800	
燦ホールディングス	8,400	2,078.00	17,455,200	
スバル興業	1,000	9,170.00	9,170,000	
東京テアトル	6,000	1,124.00	6,744,000	
タナベコンサルティンググループ	6,800	880.00	5,984,000	
ナガワ	5,000	7,610.00	38,050,000	
東京都競馬	15,600	3,700.00	57,720,000	
カナモト	34,000	2,240.00	76,160,000	
西尾レントオール	17,300	3,065.00	53,024,500	
トランス・コスモス	23,100	3,365.00	77,731,500	
乃村工藝社	81,000	898.00	72,738,000	
藤田観光	8,200	3,335.00	27,347,000	
KNT-CTホールディングス	11,000	1,737.00	19,107,000	
日本管財	19,500	2,536.00	49,452,000	
トーカイ	16,500	1,907.00	31,465,500	
セコム	188,200	7,772.00	1,462,690,400	
セントラル警備保障	10,100	2,474.00	24,987,400	
丹青社	36,300	707.00	25,664,100	
メイテック	73,800	2,407.00	177,636,600	
応用地質	17,400	1,992.00	34,660,800	
船井総研ホールディングス	38,900	2,737.00	106,469,300	
進学会ホールディングス	6,500	300.00	1,950,000	
オオバ	10,800	707.00	7,635,600	
いであ	3,800	1,540.00	5,852,000	
学究社	7,500	1,972.00	14,790,000	

ベネッセホールディングス	69,100	1,959.00	135,366,900	
イオンディライト	20,500	3,005.00	61,602,500	
ナック	8,500	970.00	8,245,000	
ダイセキ	37,800	4,035.00	152,523,000	
ステップ	7,800	1,770.00	13,806,000	
合 計	207,813,100		514,788,872,960	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

	2023年2月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	92,180,809
株式	10,220,833,340
投資証券	142,916,000
派生商品評価勘定	3,221,428
未収配当金	14,957,430
差入委託証拠金	3,610,500
流動資産合計	10,477,719,507
資産合計	10,477,719,507
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	42,528
前受金	3,182,750
未払解約金	3,321
未払利息	19
流動負債合計	3,228,618
負債合計	3,228,618
純資産の部	
元本等	
元本	9,766,829,960

剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	707,660,929
元本等合計	10,474,490,889
純資産合計	10,474,490,889
負債純資産合計	10,477,719,507

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年2月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2023年2月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,766,829,960 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.0725 円 (1万口当たり純資産額) (10,725 円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年2月17日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p> <p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。</p>
-------------------	---

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年 2月 17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年 2月 17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 2月 18日
期首元本額	445,412,688円
期中追加設定元本額	9,520,919,242円
期中一部解約元本額	199,501,970円
期末元本額	9,766,829,960円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	255,171,736円
コア投資戦略ファンド(成長型)	552,032,281円
コア投資戦略ファンド(切替型)	237,033,341円

国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	7,539,301,747円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	116,243,652円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	177,935,243円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	35,123,143円
DC日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスファンド	707,885,355円
私募日本株式ESGセレクト・リーダーズパッシブファンド（適格機関投資家専用）	41,613,814円
FOFs用 日本株式ESGセレクト・リーダーズ・インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	104,489,648円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年2月17日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	444,817,577	
投資証券	△14,813,352	
合計	430,004,225	

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

(2023年2月17日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	106,184,750	—	109,367,500	3,182,750
合計		106,184,750	—	109,367,500	3,182,750

(注)1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
I N P E X	37,000	1,438.00	53,206,000	
大林組	23,100	969.00	22,383,900	
清水建設	19,700	724.00	14,262,800	
住友林業	5,000	2,624.00	13,120,000	
大和ハウス工業	21,300	3,109.00	66,221,700	

積水ハウス	21,900	2,519.50	55,177,050	
高砂熱学工業	1,600	1,992.00	3,187,200	
大気社	900	3,520.00	3,168,000	
千代田化工建設	5,600	423.00	2,368,800	
明治ホールディングス	4,000	6,400.00	25,600,000	
サッポロホールディングス	2,200	3,080.00	6,776,000	
アサヒグループホールディングス	16,200	4,668.00	75,621,600	
キリンホールディングス	29,300	1,996.50	58,497,450	
サントリー食品インターナショナル	5,000	4,680.00	23,400,000	
伊藤園	1,900	4,470.00	8,493,000	
不二製油グループ本社	1,600	1,982.00	3,171,200	
キッコーマン	5,200	6,520.00	33,904,000	
味の素	16,300	4,038.00	65,819,400	
キュービー	3,300	2,250.00	7,425,000	
ハウス食品グループ本社	2,200	2,691.00	5,920,200	
カゴメ	2,700	3,000.00	8,100,000	
ニチレイ	3,800	2,678.00	10,176,400	
日清食品ホールディングス	2,200	11,280.00	24,816,000	
東洋紡	2,900	1,024.00	2,969,600	
帝人	6,300	1,423.00	8,964,900	
東レ	49,400	788.00	38,927,200	
クラレ	11,400	1,184.00	13,497,600	
旭化成	44,700	938.20	41,937,540	
住友化学	53,000	473.00	25,069,000	
東ソー	9,300	1,748.00	16,256,400	
デンカ	2,700	2,904.00	7,840,800	
カネカ	1,700	3,400.00	5,780,000	
三井化学	6,600	3,190.00	21,054,000	
J S R	6,300	3,130.00	19,719,000	
東京応化工業	1,100	7,230.00	7,953,000	
三菱ケミカルグループ	45,600	805.80	36,744,480	
ダイセル	9,200	930.00	8,556,000	
積水化学工業	13,200	1,801.00	23,773,200	
UBE	3,400	2,049.00	6,966,600	
花王	16,900	5,080.00	85,852,000	
日本ペイントホールディングス	29,500	1,254.00	36,993,000	

関西ペイント	6,300	1,839.00	11,585,700
D I C	2,700	2,374.00	6,409,800
富士フイルムホールディングス	12,800	6,399.00	81,907,200
ライオン	8,300	1,463.00	12,142,900
小林製薬	1,900	8,300.00	15,770,000
デクセリアルズ	2,000	2,717.00	5,434,000
日東電工	5,100	8,390.00	42,789,000
信越ポリマー	1,500	1,353.00	2,029,500
ニフコ	2,900	3,490.00	10,121,000
ユニ・チャーム	14,400	5,050.00	72,720,000
協和キリン	9,600	2,940.00	28,224,000
アステラス製薬	65,300	1,927.00	125,833,100
塩野義製薬	9,400	6,147.00	57,781,800
中外製薬	23,900	3,556.00	84,988,400
エーザイ	9,000	7,625.00	68,625,000
小野薬品工業	12,900	2,847.00	36,726,300
参天製薬	12,800	995.00	12,736,000
第一三共	62,400	4,300.00	268,320,000
E N E O S ホールディングス	109,200	459.40	50,166,480
ブリヂストン	20,300	5,148.00	104,504,400
住友理工	1,300	713.00	926,900
太平洋セメント	4,100	2,408.00	9,872,800
T O T O	5,000	4,560.00	22,800,000
日本特殊陶業	5,500	2,733.00	15,031,500
日本製鉄	28,800	3,050.00	87,840,000
神戸製鋼所	12,000	877.00	10,524,000
J F E ホールディングス	17,500	1,705.00	29,837,500
日本軽金属ホールディングス	2,000	1,431.00	2,862,000
三井金属鉱業	1,900	3,375.00	6,412,500
三菱マテリアル	4,200	2,130.00	8,946,000
住友金属鉱山	8,800	5,183.00	45,610,400
D O W A ホールディングス	1,900	4,490.00	8,531,000
U A C J	1,100	2,468.00	2,714,800
L I X I L	10,200	2,131.00	21,736,200
三浦工業	3,100	3,390.00	10,509,000
ナブテスコ	3,900	3,655.00	14,254,500

小松製作所	32,900	3,262.00	107,319,800
日立建機	3,800	3,065.00	11,647,000
クボタ	36,300	2,047.00	74,306,100
荏原製作所	3,300	5,550.00	18,315,000
ダイキン工業	8,900	23,085.00	205,456,500
栗田工業	3,700	6,020.00	22,274,000
ダイフク	3,600	7,270.00	26,172,000
グローリー	1,700	2,651.00	4,506,700
セガサミーホールディングス	5,600	2,396.00	13,417,600
日立造船	5,800	887.00	5,144,600
三菱重工業	11,400	5,084.00	57,957,600
イビデン	4,000	4,565.00	18,260,000
コニカミノルタ	16,100	587.00	9,450,700
日立製作所	34,500	6,988.00	241,086,000
富士電機	4,500	5,230.00	23,535,000
安川電機	8,500	5,130.00	43,605,000
明電舎	1,100	1,919.00	2,110,900
オムロン	6,600	7,305.00	48,213,000
富士通	7,000	17,695.00	123,865,000
セイコーエプソン	10,000	1,853.00	18,530,000
パナソニック ホールディングス	78,600	1,203.50	94,595,100
アンリツ	4,800	1,251.00	6,004,800
ソニーグループ	44,900	11,480.00	515,452,000
TDK	13,800	4,595.00	63,411,000
アルプスアルパイン	7,000	1,443.00	10,101,000
日本航空電子工業	1,600	2,266.00	3,625,600
横河電機	8,100	2,086.00	16,896,600
アズビル	4,100	3,600.00	14,760,000
アドバンテスト	6,800	10,050.00	68,340,000
シスメックス	6,000	8,355.00	50,130,000
スタンレー電気	4,600	2,862.00	13,165,200
ファナック	6,800	22,760.00	154,768,000
ローム	3,100	10,590.00	32,829,000
京セラ	11,400	6,626.00	75,536,400
太陽誘電	4,200	4,195.00	17,619,000
村田製作所	20,500	7,515.00	154,057,500

リコー	20,400	1,031.00	21,032,400	
東京エレクトロン	5,300	46,190.00	244,807,000	
川崎重工業	5,400	3,040.00	16,416,000	
トヨタ自動車	377,500	1,907.50	720,081,250	
マツダ	20,200	1,172.00	23,674,400	
ヤマハ発動機	10,600	3,385.00	35,881,000	
テルモ	23,000	3,729.00	85,767,000	
島津製作所	8,400	3,865.00	32,466,000	
ニコン	10,800	1,270.00	13,716,000	
前田工織	600	3,245.00	1,947,000	
大建工業	400	2,101.00	840,400	
大日本印刷	7,900	3,615.00	28,558,500	
N I S S H A	1,400	1,786.00	2,500,400	
アシックス	5,700	3,275.00	18,667,500	
ヤマハ	5,000	4,950.00	24,750,000	
リンテック	1,400	2,187.00	3,061,800	
任天堂	39,300	5,456.00	214,420,800	
コクヨ	3,000	1,805.00	5,415,000	
美津濃	600	2,945.00	1,767,000	
東北電力	16,100	663.00	10,674,300	
九州電力	14,400	740.00	10,656,000	
電源開発	5,200	2,127.00	11,060,400	
レノバ	1,300	2,192.00	2,849,600	
東京瓦斯	13,900	2,678.00	37,224,200	
大阪瓦斯	13,400	2,143.00	28,716,200	
東邦瓦斯	2,600	2,510.00	6,526,000	
相鉄ホールディングス	2,800	2,273.00	6,364,400	
東急	18,900	1,574.00	29,748,600	
京王電鉄	3,700	4,660.00	17,242,000	
西日本旅客鉄道	7,800	5,217.00	40,692,600	
西武ホールディングス	8,100	1,398.00	11,323,800	
西日本鉄道	2,100	2,412.00	5,065,200	
阪急阪神ホールディングス	8,100	3,820.00	30,942,000	
南海電気鉄道	3,600	2,756.00	9,921,600	
京阪ホールディングス	3,400	3,325.00	11,305,000	
山九	1,900	4,905.00	9,319,500	

センコーグループホールディングス	3,600	974.00	3,506,400
九州旅客鉄道	4,800	2,913.00	13,982,400
S Gホールディングス	10,300	2,076.00	21,382,800
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	2,700	7,540.00	20,358,000
日本郵船	17,300	3,355.00	58,041,500
トランコム	300	6,830.00	2,049,000
T I S	8,000	3,430.00	27,440,000
S H I F T	400	22,480.00	8,992,000
オーブンドア	400	1,613.00	645,200
マネーフォワード	1,500	4,830.00	7,245,000
ビジョナル	600	8,940.00	5,364,000
野村総合研究所	14,100	2,970.00	41,877,000
メルカリ	3,700	2,539.00	9,394,300
Zホールディングス	95,100	381.80	36,309,180
伊藤忠テクノソリューションズ	3,400	3,060.00	10,404,000
サイボウズ	800	2,603.00	2,082,400
B I P R O G Y	2,500	2,945.00	7,362,500
ビジョン	1,300	1,532.00	1,991,600
K D D I	57,400	3,991.00	229,083,400
ソフトバンク	102,200	1,527.00	156,059,400
エヌ・ティ・ティ・データ	22,500	1,876.00	42,210,000
カプコン	6,200	4,540.00	28,148,000
S C S K	5,600	1,925.00	10,780,000
あらた	500	3,980.00	1,990,000
T O K A Iホールディングス	3,500	858.00	3,003,000
アズワン	1,000	5,720.00	5,720,000
伊藤忠商事	42,300	4,135.00	174,910,500
丸紅	55,000	1,755.00	96,525,000
三井物産	51,000	3,950.00	201,450,000
キャノンマーケティングジャパン	1,600	3,080.00	4,928,000
サンゲツ	1,500	2,346.00	3,519,000
モスフードサービス	900	3,095.00	2,785,500
イエローハット	1,200	1,755.00	2,106,000
ローソン	1,600	5,380.00	8,608,000
ゲオホールディングス	800	1,776.00	1,420,800

ハローズ	300	3,340.00	1,002,000	
大黒天物産	200	4,855.00	971,000	
D C Mホールディングス	3,900	1,180.00	4,602,000	
マツキヨココカラ&カンパニー	3,800	6,610.00	25,118,000	
Z O Z O	4,400	3,035.00	13,354,000	
オイシックス・ラ・大地	1,000	2,463.00	2,463,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,900	1,127.00	2,141,300	
イオン北海道	1,500	890.00	1,335,000	
スギホールディングス	1,200	5,680.00	6,816,000	
日本瓦斯	3,700	1,866.00	6,904,200	
マックスバリュ東海	300	2,825.00	847,500	
丸井グループ	6,300	2,055.00	12,946,500	
イオン	23,300	2,614.00	60,906,200	
平和堂	900	2,156.00	1,940,400	
ヤオコー	600	6,790.00	4,074,000	
Genky Drug Stores	300	4,230.00	1,269,000	
ヤマダホールディングス	25,800	479.00	12,358,200	
ファーストリテイリング	2,100	82,890.00	174,069,000	
サンドラッグ	2,600	3,660.00	9,516,000	
しずおかフィナンシャルグループ	15,900	1,098.00	17,458,200	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	425,500	981.00	417,415,500	
りそなホールディングス	76,900	734.50	56,483,050	
三井住友トラスト・ホールディングス	12,000	4,885.00	58,620,000	
三井住友フィナンシャルグループ	46,500	5,924.00	275,466,000	
大和証券グループ本社	47,500	626.00	29,735,000	
野村ホールディングス	103,600	548.10	56,783,160	
マネックスグループ	6,200	513.00	3,180,600	
S O M P Oホールディングス	11,100	5,641.00	62,615,100	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	15,900	4,390.00	69,801,000	
第一生命ホールディングス	34,900	2,988.00	104,281,200	
東京海上ホールディングス	65,400	2,827.50	184,918,500	
東京センチュリー	1,300	4,570.00	5,941,000	
オリックス	42,500	2,352.00	99,960,000	
ヒューリック	13,700	1,074.00	14,713,800	
野村不動産ホールディングス	4,200	2,897.00	12,167,400	

三井不動産	32,300	2,457.00	79,361,100	
三菱地所	42,100	1,622.00	68,286,200	
平和不動産	1,100	3,585.00	3,943,500	
東京建物	6,700	1,580.00	10,586,000	
住友不動産	11,000	3,080.00	33,880,000	
総合警備保障	2,700	3,530.00	9,531,000	
ディップ	1,300	3,720.00	4,836,000	
エスプール	2,400	679.00	1,629,600	
H. U. グループホールディングス	1,800	2,664.00	4,795,200	
オリエンタルランド	7,100	21,590.00	153,289,000	
ダスキン	1,500	3,080.00	4,620,000	
サイバーエージェント	15,300	1,210.00	18,513,000	
テクノプロ・ホールディングス	3,900	3,490.00	13,611,000	
リクルートホールディングス	51,300	3,841.00	197,043,300	
エラン	1,100	1,066.00	1,172,600	
インソース	1,700	1,362.00	2,315,400	
カーブスホールディングス	1,800	783.00	1,409,400	
LITALICO	700	2,569.00	1,798,300	
乃村工藝社	2,800	898.00	2,514,400	
ベネッセホールディングス	2,600	1,959.00	5,093,400	
合 計	3,883,000		10,220,833,340	

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘 柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	森ヒルズリート投資法人	55	8,211,500	
	日本プロロジスリート投資法人	76	21,720,800	
	ヒューリックリート投資法人	46	7,061,000	
	積水ハウス・リート投資法人	150	10,485,000	
	日本ビルファンド投資法人	54	30,402,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	44	24,684,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	30	10,635,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	105	15,750,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	30	8,682,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	43	5,284,700	
合 計		633	142,916,000	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年2月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	8,482,176,885
コール・ローン	730,569,518
株式	519,388,485,971
投資信託受益証券	206,458,546
投資証券	11,942,157,730
派生商品評価勘定	441,034,359
未収入金	2,515,772
未収配当金	538,204,739
差入委託証拠金	3,921,432,962
流動資産合計	545,653,036,482
資産合計	545,653,036,482
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,204,011
前受金	418,188,665
未払解約金	59,561,688
未払利息	154
流動負債合計	499,954,518
負債合計	499,954,518
純資産の部	
元本等	
元本	121,979,552,292
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	423,173,529,672
元本等合計	545,153,081,964
純資産合計	545,153,081,964
負債純資産合計	545,653,036,482

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2023年2月17日現在

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>2. デリバティブの評価基準及び評価方法</p> <p>3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準</p> <p>4. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p> <p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>
---	---

(貸借対照表に関する注記)

<p>1. 計算期間の末日における受益権の総数</p>	<p>2023年2月17日現在</p> <p>121,979,552,292 口</p>
-----------------------------	--

2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	4,4692 円 (44,692 円)
----------------------------	-----------------------------	------------------------

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年2月17日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年2月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年2月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年2月18日
期首元本額	124,000,147,376円
期中追加設定元本額	18,420,784,349円
期中一部解約元本額	20,441,379,433円
期末元本額	121,979,552,292円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,857,180,206円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,398,661円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	33,849,751,477円
世界経済インデックスファンド	11,020,003,592円
外国株式インデックス・オープン	906,197,517円
DCマイセレクション25	791,037,161円
DCマイセレクション50	3,667,282,403円
DCマイセレクション75	4,407,982,914円
DC外国株式インデックス・オープン	12,315,989,982円
DCマイセレクションS25	413,400,922円
DCマイセレクションS50	1,903,938,183円
DCマイセレクションS75	1,710,816,949円
DCターゲット・イヤーフンド2025	35,300,286円
DCターゲット・イヤーフンド2035	152,536,542円
DCターゲット・イヤーフンド2045	114,844,189円
DC世界経済インデックスファンド	9,080,558,873円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,169,106,981円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	3,091,662円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	3,459,609円
外国株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	25,689,166円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	10,748,557円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	40,763,634円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	8,917,138円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	24,210,006円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	218,020,631円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	156,311,172円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,155,737,563円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	87,268,058円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	22,082,454円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	144,783,518円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	46,252,533円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	923,401,665円
FOFs用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,016,257,864円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,173,370,508円
コア投資戦略ファンド(安定型)	491,761,850円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,181,204,042円
分散投資コア戦略ファンドA	1,580,128,367円
分散投資コア戦略ファンドS	8,402,108,841円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,303,626,270円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	975,960,680円
コア投資戦略ファンド(切替型)	501,278,254円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	528,206,318円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	24,596,551円
SMT インデックスバランス・オープン	132,712,907円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	313,818,952円

外国株式SMTBセレクション (SMA専用)	10,845,602,392 円
SMT 世界経済インデックス・オープン	220,242,946 円
SMT 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	871,876,111 円
SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	151,053,935 円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,719,919 円
My SMT グローバル株式インデックス (ノーロード)	544,082,910 円
グローバル経済コア	533,729,045 円
SBI資産設計オープン (つみたてNISA対応型)	14,914,956 円
DCターゲット・イヤーフンド2055	5,825,216 円
コア投資戦略ファンド (切替型ワイド)	456,682,822 円
コア投資戦略ファンド (積極成長型)	93,594,384 円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2030	58,937,010 円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2040	52,492,158 円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2050	22,779,949 円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2060	32,317,550 円
10資産分散投資ファンド	54,226,763 円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS (適格機関投資家専用)	228,827,947 円
外株インデックス・ファンド (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用)	26,667,873 円
外株インデックス・ファンド2 (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用)	887,094,769 円
世界株式ファンド (適格機関投資家専用)	1,441,106,270 円
FOFs用世界成長戦略ファンド (適格機関投資家専用)	104,468,637 円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド (適格機関投資家専用)	84,694,698 円
私募世界経済パッシブファンド (適格機関投資家専用)	80,455,994 円
ファンドラップ運用戦略F (中庸型) (適格機関投資家専用)	74,206,817 円
SMTAM海外バランスファンド2020-01 (適格機関投資家専用)	223,103,117 円
SMTAM海外バランスファンド2020-08 (適格機関投資家専用)	213,286,445 円
SMTAM海外バランスファンド2020-11 (適格機関投資家専用)	212,187,298 円
SMTAM海外バランスファンド2021-04 (適格機関投資家専用)	217,861,630 円
SMTAM海外バランスファンド2021-07 (適格機関投資家専用)	215,611,827 円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11 (適格機関投資家専用)	108,805,296 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年2月17日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	1,979,816,569	
投資信託受益証券	△34,727,458	
投資証券	△1,328,896,505	
合計	616,192,606	

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式インデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2023年2月17日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	
市場取引	株価指数先物取引	12,891,841,944	13,310,030,609	418,188,665
	買建			

合計	12,891,841,944	—	13,310,030,609	418,188,665
----	----------------	---	----------------	-------------

(注)1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

(2023年2月17日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	593,236,980	—	593,886,083	649,103
	アメリカドル	469,210,000	—	470,144,850	934,850
	イギリスポンド	124,026,980	—	123,741,233	△285,747
	売建	142,360,014	—	142,367,434	△7,420
	アメリカドル	142,360,014	—	142,367,434	△7,420
合計		735,596,994	—	736,253,517	641,683

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

- ①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。
- ②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	23,392	40.14	938,954.88	
	BAKER HUGHES CO	77,332	32.26	2,494,730.32	
	CHENIERE ENERGY INC	18,243	148.80	2,714,558.40	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	83.91	711,724.62	
	CHEVRON CORP	146,184	166.57	24,349,868.88	
	CONOCOPHILLIPS	100,289	108.36	10,867,316.04	
	COTERRA ENERGY INC	64,000	24.61	1,575,040.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	55.72	2,800,264.32	

DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	141.76	1,880,729.92
EOG RESOURCES INC	46,173	125.14	5,778,089.22
EQT CORPORATION	27,026	31.83	860,237.58
EXXON MOBIL	327,418	115.73	37,892,085.14
HALLIBURTON CO	70,302	38.58	2,712,251.16
HESS CORP	21,535	143.76	3,095,871.60
HF SINCLAIR CORP	13,429	53.81	722,614.49
KINDER MORGAN INC	157,856	18.09	2,855,615.04
MARATHON OIL CORP	50,360	26.78	1,348,640.80
MARATHON PETROLEUM CORP	39,098	126.51	4,946,287.98
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	73,085	62.50	4,567,812.50
ONEOK INC	35,533	69.19	2,458,528.27
OVINTIV INC	20,998	46.72	981,026.56
PHILLIPS 66	37,618	104.92	3,946,880.56
PIONEER NATURAL RESOURCES	17,482	216.37	3,782,580.34
SCHLUMBERGER	111,773	55.78	6,234,697.94
TARGA RESOURCES CORP	17,298	76.08	1,316,031.84
TEXAS PACIFIC LAND CORP	533	1,874.52	999,119.16
VALERO ENERGY CORP	30,789	133.97	4,124,802.33
WILLIAMS COS	98,553	32.09	3,162,565.77
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,457	280.73	4,900,703.61
ALBEMARLE CORP	9,440	285.62	2,696,252.80
ALCOA CORP	15,500	48.77	755,935.00
AMCOR PLC	110,292	11.41	1,258,431.72
AVERY DENNISON CORP	6,638	182.05	1,208,447.90
BALL CORP	25,605	57.39	1,469,470.95
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	121.23	1,040,395.86
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,527	85.31	1,409,918.37
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	20.59	885,370.00
CORTEVA INC	55,406	62.75	3,476,726.50
CROWN HOLDINGS INC	9,940	87.72	871,936.80
DOW INC	55,796	58.68	3,274,109.28
DUPONT DE NEMOURS INC	38,372	75.47	2,895,934.84
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	86.91	767,589.12
ECOLAB INC	19,940	161.99	3,230,080.60
FMC CORP	10,507	129.00	1,355,403.00

FREEMPORT-MCMORAN INC	111,600	42.76	4,772,016.00
INT'L PAPER CO	25,191	38.64	973,380.24
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	96.05	1,854,437.35
LINDE PLC	39,250	323.50	12,697,375.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	98.75	1,949,818.75
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,892	368.93	1,804,805.56
MOSAIC CO/THE	27,732	50.40	1,397,692.80
NEWMONT CORPORATION	61,808	45.85	2,833,896.80
NUCOR CORP	20,956	169.82	3,558,747.92
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	141.48	1,087,556.76
PPG INDUSTRIES INC	17,805	129.15	2,299,515.75
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	87.78	917,827.68
SEALED AIR CORP	11,690	49.87	582,980.30
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,339	227.13	4,392,467.07
STEEL DYNAMICS INC	13,766	126.18	1,736,993.88
VULCAN MATERIALS CO	10,153	185.37	1,882,061.61
WESTLAKE CORP	2,222	123.95	275,416.90
WESTROCK CO	21,356	33.09	706,670.04
3 M COMPANY	43,028	112.00	4,819,136.00
AERCAP HOLDINGS NV	11,005	63.15	694,965.75
ALLEGION PLC	7,601	118.75	902,618.75
AMETEK INC	17,753	144.55	2,566,196.15
BOEING CO	44,686	212.21	9,482,816.06
CARLISLE COS INC	4,378	259.85	1,137,623.30
CARRIER GLOBAL CORP	68,158	45.23	3,082,786.34
CATERPILLAR	42,201	246.52	10,403,390.52
CUMMINS INC	11,372	253.97	2,888,146.84
DEERE&CO	23,165	402.96	9,334,568.40
DOVER CORP	10,657	154.94	1,651,195.58
EATON CORP	31,311	174.11	5,451,558.21
EMERSON ELECTRIC CO	46,386	85.70	3,975,280.20
FASTENAL CO	44,011	53.02	2,333,463.22
FERGUSON PLC	16,011	148.37	2,375,552.07
FORTIVE CORP	25,400	68.70	1,744,980.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	64.49	664,891.90
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	129.91	676,961.01

GENERAL DYNAMICS CORP	18,970	231.30	4,387,761.00
GENERAL ELECTRIC CO	84,763	84.05	7,124,330.15
GRAINGER (WW) INC	3,667	670.09	2,457,220.03
HEICO CORP	3,640	175.33	638,201.20
HEICO CORP-CLASS A	4,949	137.73	681,625.77
HONEYWELL INTL INC	52,641	199.36	10,494,509.76
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	42.95	1,356,962.30
HUBBELL INC	4,432	250.25	1,109,108.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	218.92	771,036.24
IDEX CORP	5,916	225.09	1,331,632.44
ILLINOIS TOOL WORKS	24,371	237.48	5,787,625.08
INGERSOLL-RAND INC	31,562	57.39	1,811,343.18
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	51.85	658,495.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	53,782	64.45	3,466,249.90
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	211.45	3,104,508.90
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	266.85	674,063.10
LOCKHEED MARTIN CORP	18,902	471.25	8,907,567.50
MASCO CORP	19,462	55.81	1,086,174.22
NORDSON CORP	4,121	242.48	999,260.08
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,590	465.35	5,393,406.50
OTIS WORLDWIDE CORP	33,858	83.59	2,830,190.22
OWENS CORNING	6,460	101.68	656,852.80
PACCAR INC	42,159	74.87	3,156,444.33
PARKER HANNIFIN CORP	9,779	354.54	3,467,046.66
PENTAIR PLC	14,533	56.34	818,789.22
PLUG POWER INC	41,884	15.84	663,442.56
QUANTA SERVICES INC	11,465	155.32	1,780,743.80
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	115,485	100.97	11,660,520.45
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,188	295.88	2,718,545.44
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	52.38	724,310.64
SMITH (A. O.) CORP	9,016	67.72	610,563.52
SNAP-ON INC	4,000	252.45	1,009,800.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	90.20	1,136,339.60
TEXTRON	16,934	74.55	1,262,429.70
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,638	184.04	3,430,137.52
TRANSDIGM GROUP INC	3,986	748.67	2,984,198.62

UNITED RENTALS INC	5,364	462.02	2,478,275.28
WABTEC CORP	12,976	104.38	1,354,434.88
XYLEM INC	15,077	106.25	1,601,931.25
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	96.48	1,096,398.72
CINTAS CORP	6,981	441.36	3,081,134.16
CLARIVATE PLC	27,357	10.86	297,097.02
COPART INC	32,281	68.93	2,225,129.33
COSTAR GROUP INC	32,116	78.18	2,510,828.88
EQUIFAX INC	9,230	213.00	1,965,990.00
JACOBS SOLUTIONS INC	10,661	122.55	1,306,505.55
LEIDOS HOLDINGS	11,220	99.43	1,115,604.60
REPUBLIC SERVICES INC	16,730	129.99	2,174,732.70
ROBERT HALF INTL INC	9,566	82.90	793,021.40
ROLLINS INC	17,468	36.18	631,992.24
TRANSUNION	15,741	70.48	1,109,425.68
VERISK ANALYTICS INC	12,079	176.22	2,128,561.38
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	136.36	2,696,519.00
WASTE MANAGEMENT INC	32,506	152.27	4,949,688.62
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,277	103.73	1,066,033.21
CSX CORP	169,261	31.11	5,265,709.71
DELTA AIR LINES INC	14,609	38.28	559,232.52
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	112.20	1,377,816.00
FEDEX CORP	19,274	211.67	4,079,727.58
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	83,011	3.67	304,650.37
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	187.95	1,325,423.40
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,280	59.99	616,697.20
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,087	230.02	4,390,391.74
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,302	351.93	2,569,792.86
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	35.41	479,203.53
U-HAUL HOLDING CO	6,606	57.70	381,166.20
UBER TECHNOLOGIES INC	113,979	36.22	4,128,319.38
UNION PACIFIC CORP	48,838	200.52	9,792,995.76
UNITED PARCEL SERVICE B	57,229	185.55	10,618,840.95
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	7,175	21.25	152,468.75
APTIV PLC	20,562	120.73	2,482,450.26
BORGWARNER INC	19,781	50.32	995,379.92

FORD MOTOR COMPANY	306,411	12.91	3,955,766.01
GENERAL MOTORS CO	108,298	43.10	4,667,643.80
LEAR CORP	5,287	142.98	755,935.26
LUCID GROUP INC	31,234	10.63	332,017.42
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	26,935	20.68	557,015.80
TESLA INC	209,202	202.04	42,267,172.08
DR HORTON INC	25,466	97.15	2,474,021.90
GARMIN LTD	12,854	97.15	1,248,766.10
HASBRO INC	10,572	58.46	618,039.12
LENNAR CORP-CL A	20,844	101.30	2,111,497.20
LULULEMON ATHLETICA INC	9,374	321.83	3,016,834.42
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	116.02	482,991.26
NEWELL BRANDS INC	31,461	15.30	481,353.30
NIKE B	99,374	124.38	12,360,138.12
NVR INC	247	5,119.96	1,264,630.12
PULTE GROUP INC	16,747	55.91	936,324.77
VF CORP	25,718	27.07	696,186.26
WHIRLPOOL CORP	3,785	145.12	549,279.20
AIRBNB INC-CLASS A	29,236	139.42	4,076,083.12
ARAMARK	16,686	38.32	639,407.52
BOOKING HOLDINGS INC	3,135	2,493.18	7,816,119.30
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	52.18	916,280.80
CARNIVAL CORPORATION	84,361	11.60	978,587.60
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,159	1,621.24	3,500,257.16
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	145.76	1,342,012.32
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	356.83	1,016,251.84
EXPEDIA GROUP INC	11,638	111.53	1,297,986.14
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	22,125	148.28	3,280,695.00
LAS VEGAS SANDS CORP	25,560	56.82	1,452,319.20
MARRIOTT INTL A	21,339	175.79	3,751,182.81
MCDONALD'S CORP	57,558	265.83	15,300,643.14
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,754	44.20	1,005,726.80
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,116	73.90	1,264,872.40
STARBUCKS CORP	90,925	107.54	9,778,074.50
VAIL RESORTS INC	3,014	248.27	748,285.78
WYNN RESORTS LTD	9,302	108.47	1,008,987.94

YUM BRANDS INC	21,705	131.72	2,858,982.60
ACTIVISION BLIZZARD INC	61,442	77.51	4,762,369.42
ALPHABET INC-CL A	472,221	95.51	45,101,827.71
ALPHABET INC-CL C	436,836	95.78	41,840,152.08
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	8,752	400.37	3,504,038.24
COMCAST CORP-CL A	344,872	39.72	13,698,315.84
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	14.10	283,861.20
ELECTRONIC ARTS INC	21,551	111.72	2,407,677.72
FOX CORP - CLASS A	21,544	36.73	791,311.12
FOX CORP- CLASS B	10,345	33.99	351,626.55
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	37.20	1,060,609.20
LIBERTY BROADBAND-C	9,153	94.00	860,382.00
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	69.96	1,075,914.84
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	33.84	459,682.56
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	33.92	216,545.28
LIVE NATION ENTERTAINMENT	14,491	78.21	1,133,341.11
MATCH GROUP INC	22,730	43.92	998,301.60
META PLATFORMS INC-CLASS A	179,617	172.44	30,973,155.48
NETFLIX INC	35,024	350.71	12,283,267.04
NEWS CORP-CLASS A	33,479	18.70	626,057.30
OMNICOM GROUP	16,538	93.20	1,541,341.60
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	48,586	23.50	1,141,771.00
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	24.84	1,136,852.28
ROBLOX CORP -CLASS A	28,059	43.58	1,222,811.22
ROKU INC	9,122	70.57	643,739.54
SEA LTD-ADR	28,338	66.83	1,893,828.54
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	4.61	278,757.48
SNAP INC - A	83,375	10.73	894,613.75
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	112.52	1,447,794.84
THE WALT DISNEY CO	142,971	105.83	15,130,620.93
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	36,671	63.07	2,312,839.97
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	15.31	2,716,193.03
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	26.40	579,084.00
ADVANCE AUTO PARTS	4,016	150.19	603,163.04
AMAZON.COM	722,070	98.15	70,871,170.50
AUTOZONE INC	1,572	2,571.35	4,042,162.20

BATH & BODY WORKS INC	19,806	42.91	849,875.46
BEST BUY COMPANY INC	15,285	88.20	1,348,137.00
BURLINGTON STORES INC	5,108	226.90	1,159,005.20
CARMAX INC	13,591	74.32	1,010,083.12
CHEWY INC - CLASS A	6,878	47.23	324,847.94
DOLLAR GENERAL CORP	17,687	228.82	4,047,139.34
DOLLAR TREE INC	17,931	146.85	2,633,167.35
DOORDASH INC - A	19,212	66.89	1,285,090.68
EBAY	41,952	48.66	2,041,384.32
ETSY INC	10,294	130.31	1,341,411.14
GENUINE PARTS CO	11,319	179.15	2,027,798.85
HOME DEPOT	80,384	321.24	25,822,556.16
LKQ CORP	19,286	57.90	1,116,659.40
LOWES COMPANIES	48,809	214.01	10,445,614.09
MERCADOLIBRE INC	3,725	1,119.64	4,170,659.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,175	862.00	4,460,850.00
POOL CORP	3,304	389.70	1,287,568.80
ROSS STORES INC	28,076	115.32	3,237,724.32
TARGET (DAYTON HUDSON)	36,243	174.54	6,325,853.22
TJX COMPANIES INC	91,766	79.62	7,306,408.92
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	236.98	2,114,335.56
ULTA BEAUTY INC	3,920	531.56	2,083,715.20
COSTCO WHOLESALE CORP	34,886	504.10	17,586,032.60
KROGER CO	51,785	43.85	2,270,772.25
SYSCO CORP	39,357	77.47	3,048,986.79
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	36.32	2,170,737.44
WALMART INC	117,948	144.27	17,016,357.96
ALTRIA GROUP INC	142,110	47.40	6,736,014.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	43,835	81.42	3,569,045.70
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	65.42	1,570,472.52
BUNGE LIMITED	11,604	97.55	1,131,970.20
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	50.89	807,573.41
COCA-COLA CO	323,561	59.22	19,161,282.42
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	56.73	873,301.62
CONAGRA BRANDS INC	40,304	35.82	1,443,689.28
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,940	227.26	2,940,744.40

DARLING INGREDIENTS INC	13,242	67.72	896,748.24
GENERAL MILLS INC	46,616	75.11	3,501,327.76
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,019	235.22	2,827,109.18
HORMEL FOODS CORP	23,338	44.95	1,049,043.10
JM SMUCKER CO	7,850	147.22	1,155,677.00
KELLOGG CO	18,772	66.84	1,254,720.48
KEURIG DR PEPPER INC	62,155	35.90	2,231,364.50
KRAFT HEINZ CO/THE	56,727	39.78	2,256,600.06
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	100.01	1,187,718.76
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	20,790	74.31	1,544,904.90
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	51.40	753,986.60
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	108,308	65.68	7,113,669.44
MONSTER BEVERAGE CORP	30,338	104.04	3,156,365.52
PEPSICO INC	108,690	175.51	19,076,181.90
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	121,206	100.30	12,156,961.80
TYSON FOODS INC	23,306	60.69	1,414,441.14
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	82.79	1,601,655.34
CLOROX COMPANY	9,570	152.67	1,461,051.90
COLGATE-PALMOLIVE CO	62,289	72.77	4,532,770.53
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,174	249.53	4,534,958.22
KIMBERLY-CLARK CORP	26,373	126.47	3,335,393.31
PROCTER & GAMBLE CO	187,873	137.14	25,764,903.22
ABBOTT LABORATORIES	137,251	106.08	14,559,586.08
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	326.17	1,938,428.31
AMERISOURCEBERGEN CORP	11,707	160.47	1,878,622.29
BAXTER INTERNATIONAL	40,013	39.80	1,592,517.40
BECTON DICKINSON & CO	22,473	241.94	5,437,117.62
BOSTON SCIENTIFIC CORP	110,818	46.48	5,150,820.64
CARDINAL HEALTH	21,902	78.64	1,722,373.28
CENTENE CORP	45,335	73.01	3,309,908.35
CIGNA CORP	24,609	299.43	7,368,672.87
CVS HEALTH CORP	102,386	87.97	9,006,896.42
DAVITA INC	4,627	83.42	385,984.34
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	35.80	636,309.20
DEXCOM INC	30,645	117.26	3,593,432.70
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	48,456	77.28	3,744,679.68

ELEVANCE HEALTH INC	19,014	486.99	9,259,627.86
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	29,921	70.91	2,121,698.11
HCA HEALTHCARE INC	17,857	263.15	4,699,069.55
HENRY SCHEIN INC	11,747	82.82	972,886.54
HOLOGIC INC	18,875	82.62	1,559,452.50
HUMANA INC	9,946	505.69	5,029,592.74
IDEXX LABORATORIES INC	6,751	506.40	3,418,706.40
INSULET CORP	5,246	298.91	1,568,081.86
INTUITIVE SURGICAL INC	28,238	240.16	6,781,638.08
LABORATORY CRP OF AMER	7,595	256.09	1,945,003.55
MASIMO CORP	4,147	164.90	683,840.30
MCKESSON CORP	11,489	363.75	4,179,123.75
MEDTRONIC PLC	105,263	84.20	8,863,144.60
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	292.97	1,331,548.65
NOVOCURE LTD	7,933	86.64	687,315.12
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	146.66	1,272,862.14
RESMED INC	11,169	213.91	2,389,160.79
STERIS PLC	8,018	191.68	1,536,890.24
STRYKER CORP	26,887	263.21	7,076,927.27
TELEFLEX INC	3,934	246.35	969,140.90
THE COOPER COS INC	4,134	343.73	1,420,979.82
UNITEDHEALTH GROUP INC	73,518	487.35	35,828,997.30
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	149.98	700,706.56
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	173.03	1,947,452.65
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,923	125.11	2,117,236.53
ABBVIE INC	138,845	149.53	20,761,492.85
AGILENT TECHNOLOGIES	23,785	148.28	3,526,839.80
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	219.85	2,120,013.55
AMGEN	42,448	234.22	9,942,170.56
AVANTOR INC	49,647	24.37	1,209,897.39
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	455.91	844,801.23
BIO-TECHNE CORP	12,980	76.24	989,595.20
BIOGEN INC	11,060	271.53	3,003,121.80
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	107.29	1,586,068.07
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	166,811	70.85	11,818,559.35
CATALENT INC	13,739	71.89	987,696.71

CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	254.25	1,068,867.00
DANAHER CORP	54,035	255.75	13,819,451.25
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	13.25	477,808.25
EXACT SCIENCES CORP	14,756	63.77	940,990.12
GILEAD SCIENCES INC	97,590	83.39	8,138,030.10
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	109.62	1,965,048.12
ILLUMINA INC	12,687	211.82	2,687,360.34
INCYTE CORP	15,212	78.24	1,190,186.88
IQVIA HOLDINGS INC	15,126	224.00	3,388,224.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	146.32	727,356.72
JOHNSON & JOHNSON	206,738	158.24	32,714,221.12
LILLY (ELI) & CO	63,340	326.07	20,653,273.80
MERCK & CO	198,784	106.51	21,172,483.84
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,808	1,534.51	2,774,394.08
MODERNA INC	26,107	172.31	4,498,497.17
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,742	102.79	693,010.18
PERKINELMER INC	10,545	134.88	1,422,309.60
PFIZER	440,027	42.95	18,899,159.65
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,615	736.33	6,343,482.95
REPLIGEN CORP	4,353	198.10	862,329.30
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	24,752	37.24	921,764.48
SEAGEN INC	10,981	160.91	1,766,952.71
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	10.10	930,624.10
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,674	557.58	17,103,208.92
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,685	292.04	6,040,847.40
VIATRIS INC	89,720	11.65	1,045,238.00
WATERS CORP	4,749	327.33	1,554,490.17
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	319.77	1,844,113.59
ZOETIS INC	36,859	173.93	6,410,885.87
BANK OF AMERICA CORP	568,705	35.28	20,063,912.40
CITIGROUP	153,036	51.46	7,875,232.56
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	42.81	1,691,936.82
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	36.66	1,995,037.20
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	950	749.16	711,702.00
FIRST HORIZON CORP	44,308	24.82	1,099,724.56
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,984	130.72	1,958,708.48

HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	15.34	1,750,478.08
JPMORGAN CHASE & CO	230,844	141.82	32,738,296.08
KEY CORP	71,223	19.08	1,358,934.84
M & T BANK CORP	13,674	159.68	2,183,464.32
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	32,049	158.30	5,073,356.70
REGIONS FINL CORP	70,810	23.66	1,675,364.60
SIGNATURE BANK	4,686	127.02	595,215.72
SVB FINANCIAL GROUP	4,545	301.93	1,372,271.85
TRUIST FINANCIAL CORP	104,155	47.96	4,995,273.80
US BANCORP	111,007	48.55	5,389,389.85
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	55.25	788,583.25
WELLS FARGO & CO	297,746	47.22	14,059,566.12
ALLY FINANCIAL INC	27,761	31.29	868,641.69
AMERICAN EXPRESS	50,389	177.94	8,966,218.66
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,702	349.47	3,041,087.94
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,854	72.09	2,296,354.86
ARES MANAGEMENT CORP - A	12,780	83.50	1,067,130.00
BANK NEW YORK CO	61,254	51.29	3,141,717.66
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	102,259	308.18	31,514,178.62
BLACKROCK INC	11,937	713.00	8,511,081.00
BLACKSTONE INC	54,841	94.44	5,179,184.04
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	31,266	111.55	3,487,722.30
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	34.81	545,437.89
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	126.73	1,124,728.75
CME GROUP INC	28,271	188.50	5,329,083.50
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	9,576	65.59	628,089.84
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	21,002	111.63	2,344,453.26
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	32.86	919,521.38
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	427.17	1,344,731.16
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	31.20	813,384.00
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	50.08	216,145.28
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,241	370.20	10,084,618.20
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	43,833	107.13	4,695,829.29
INVESCO LTD	26,420	18.46	487,713.20
KKR & CO INC	44,282	57.55	2,548,429.10
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,386	248.19	1,584,941.34

MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	359.54	1,153,044.78
MOODY' S CORP	13,065	302.50	3,952,162.50
MORGAN STANLEY	100,851	99.57	10,041,734.07
MSCI INC	6,518	552.99	3,604,388.82
NASDAQ INC	28,971	58.44	1,693,065.24
NORTHERN TRUST CORP	15,902	95.72	1,522,139.44
PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	119.08	2,132,365.56
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	114.02	1,765,713.72
S&P GLOBAL INC	26,714	357.82	9,558,803.48
SCHWAB (CHARLES) CORP	113,833	80.34	9,145,343.22
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	61.96	591,718.00
STATE STREET CORP	29,059	93.27	2,710,332.93
SYNCHRONY FINANCIAL	36,117	35.65	1,287,571.05
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	73.26	663,808.86
AFLAC	46,816	69.13	3,236,390.08
ALLSTATE CORP	22,174	137.10	3,040,055.40
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	131.21	829,115.99
AMERICAN INT'L GROUP	59,547	62.16	3,701,441.52
AON PLC	16,687	310.25	5,177,141.75
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,726	67.10	1,994,614.60
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,436	188.63	3,100,322.68
ASSURANT INC	4,726	132.94	628,274.44
BROWN & BROWN INC	19,873	57.37	1,140,114.01
CHUBB LTD	33,210	210.26	6,982,734.60
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	125.89	1,610,258.99
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	240.62	521,182.92
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	380.36	1,250,623.68
FNF GROUP	20,461	42.94	878,595.34
GLOBE LIFE INC	8,106	121.54	985,203.24
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,731	77.49	1,916,405.19
LINCOLN NATIONAL CORP	13,484	34.47	464,793.48
LOEWS CORP	16,741	61.66	1,032,250.06
MARKEL CORP	1,156	1,322.12	1,528,370.72
MARSH & MCLENNAN COS	39,396	166.51	6,559,827.96
METLIFE INC	54,127	72.47	3,922,583.69
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,719	91.38	1,893,302.22

PROGRESSIVE CORP	45,656	142.54	6,507,806.24
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,190	103.11	3,009,780.90
TRAVELERS COS INC/THE	18,521	183.06	3,390,454.26
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,448	242.36	2,047,457.28
WR BERKLEY CORP	17,572	66.85	1,174,688.20
CBRE GROUP INC-A	25,904	88.50	2,292,504.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.74	467,838.00
WEYERHAEUSER CO	59,710	32.44	1,936,992.40
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	47.90	643,153.30
ACCENTURE PLC-CL A	49,817	281.22	14,009,536.74
ADOBE INC	36,682	365.16	13,394,799.12
AFFIRM HOLDINGS INC	12,816	13.58	174,041.28
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,484	77.07	885,071.88
ANSYS INC	6,794	273.24	1,856,392.56
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	213.19	510,376.86
AUTODESK INC	17,467	222.13	3,879,944.71
AUTOMATIC DATA PROCESS	32,866	227.48	7,476,357.68
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	40.98	573,556.08
BILL.COM HOLDINGS INC	7,443	96.51	718,323.93
BLACK KNIGHT INC	11,543	64.47	744,177.21
BLOCK INC	41,057	78.63	3,228,311.91
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	143.59	1,398,853.78
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,364	194.62	4,157,861.68
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	75.86	809,274.48
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	123.98	1,007,213.52
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	68.32	1,385,734.56
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	39,936	66.36	2,650,152.96
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	14,965	115.12	1,722,770.80
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	146.04	452,724.00
DATADOG INC - CLASS A	20,137	82.47	1,660,698.39
DOCUSIGN INC	14,969	66.65	997,683.85
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	23.96	552,709.28
DYNATRACE INC	14,790	43.77	647,358.30
EPAM SYSTEMS INC	4,220	346.01	1,460,162.20
FAIR ISAAC CORP	1,828	687.80	1,257,298.40
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	46,912	69.16	3,244,433.92

FISERV INC	47,748	115.95	5,536,380.60
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,002	214.33	1,286,408.66
FORTINET INC	51,829	61.39	3,181,782.31
GARTNER INC	6,340	346.00	2,193,640.00
GEN DIGITAL INC	43,555	21.35	929,899.25
GLOBAL PAYMENTS INC	22,567	117.35	2,648,237.45
GODADDY INC - CLASS A	11,388	79.42	904,434.96
HUBSPOT INC	3,646	361.93	1,319,596.78
INTL BUSINESS MACHINES CORP	71,616	135.00	9,668,160.00
INTUIT INC	21,209	408.36	8,660,907.24
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	165.16	860,979.08
MASTERCARD INC-CLASS A	67,952	367.55	24,975,757.60
MICROSOFT CORP	557,986	262.15	146,276,029.90
MONGODB INC	5,325	217.33	1,157,282.25
OKTA INC	11,505	75.27	865,981.35
ORACLE CORP	125,078	87.72	10,971,842.16
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	125,244	9.71	1,216,119.24
PALO ALTO NETWORKS INC	22,917	172.02	3,942,182.34
PAYCHEX INC	24,693	114.66	2,831,299.38
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	307.45	1,302,050.75
PAYLOCITY HOLDING CORP	3,423	209.20	716,091.60
PAYPAL HOLDINGS INC	86,747	76.73	6,656,097.31
PTC INC	8,226	131.46	1,081,389.96
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,672	422.97	3,667,995.84
SALESFORCE INC	78,093	168.11	13,128,214.23
SERVICENOW INC	16,202	453.69	7,350,685.38
SNOWFLAKE INC-CLASS A	17,680	164.40	2,906,592.00
SPLUNK INC	13,355	107.09	1,430,186.95
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	62.32	1,204,957.20
SYNOPSYS INC	12,539	359.71	4,510,403.69
TOAST INC-CLASS A	20,341	20.03	407,430.23
TWILIO INC - A	12,842	75.45	968,928.90
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	339.09	1,132,221.51
UNITY SOFTWARE INC	21,912	40.72	892,256.64
VERISIGN INC	7,790	207.42	1,615,801.80
VISA INC-CLASS A SHARES	128,824	225.83	29,092,323.92

VMWARE INC-CLASS A	16,717	116.26	1,943,518.42
WESTERN UNION CO	29,297	14.10	413,087.70
WIX.COM LTD	5,010	86.56	433,665.60
WORKDAY INC-CLASS A	15,455	187.75	2,901,676.25
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	19,002	77.91	1,480,445.82
ZSCALER INC	7,204	132.93	957,627.72
AMPHENOL CORPORATION	47,254	81.36	3,844,585.44
APPLE INC	1,265,668	153.71	194,545,828.28
ARISTA NETWORKS INC	18,674	141.68	2,645,732.32
ARROW ELECTRONICS INC	4,338	123.66	536,437.08
CDW CORP/DE	10,882	214.25	2,331,468.50
CISCO SYSTEMS	326,126	50.99	16,629,164.74
COGNEX CORP	14,352	55.31	793,809.12
CORNING	64,989	35.35	2,297,361.15
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	42.72	960,388.32
F5 INC	4,851	146.80	712,126.80
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	16.46	1,603,730.72
HP INC	83,910	30.27	2,539,955.70
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	31.53	798,371.13
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	186.97	2,587,290.86
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,014	267.36	3,479,423.04
NETAPP INC	18,303	67.95	1,243,688.85
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	16,583	70.53	1,169,598.99
TE CONNECTIVITY LTD	24,490	132.00	3,232,680.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	438.58	1,710,023.42
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	54.97	973,958.46
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	42.57	1,097,880.30
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	333.44	1,387,777.28
AT&T INC	559,126	19.26	10,768,766.76
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	20.72	321,491.52
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,869	21.26	401,154.94
LUMEN TECHNOLOGIES INC	73,769	3.84	283,272.96
T-MOBILE US INC	49,791	146.73	7,305,833.43
VERIZON COMMUNICATIONS	331,476	39.84	13,206,003.84
AES CORP	54,375	26.37	1,433,868.75
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	53.14	1,104,142.92

AMEREN CORPORATION	20,898	85.84	1,793,884.32
AMERICAN ELECTRIC POWER	39,907	90.70	3,619,564.90
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,892	147.46	2,048,514.32
ATMOS ENERGY CORP	11,302	115.69	1,307,528.38
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	29.05	1,378,887.30
CMS ENERGY CORP	23,697	60.97	1,444,806.09
CONSOLIDATED EDISON INC	27,140	91.66	2,487,652.40
CONSTELLATION ENERGY	25,114	85.63	2,150,511.82
DOMINION ENERGY INC	66,179	58.10	3,844,999.90
DTE ENERGY COMPANY	15,851	113.40	1,797,503.40
DUKE ENERGY CORP	60,751	98.29	5,971,215.79
EDISON INTL	30,339	67.22	2,039,387.58
ENERGY CORP	16,181	108.27	1,751,916.87
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	45.51	928,358.49
EVERGY INC	18,475	61.01	1,127,159.75
EVERSOURCE ENERGY	27,450	78.72	2,160,864.00
EXELON CORP	76,661	42.49	3,257,325.89
FIRSTENERGY CORP	40,593	40.57	1,646,858.01
NEXTERA ENERGY INC	155,688	75.69	11,784,024.72
NISOURCE INC	32,351	26.88	869,594.88
NRG ENERGY INC	19,068	34.08	649,837.44
PG&E CORP	118,132	15.55	1,836,952.60
PPL CORPORATION	58,459	28.45	1,663,158.55
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	61.77	2,437,938.36
SEMPRA ENERGY	24,582	157.47	3,870,927.54
SOUTHERN CO	85,837	65.86	5,653,224.82
UGI CORP	18,019	38.70	697,335.30
VISTRA CORP	31,797	22.82	725,607.54
WEC ENERGY GROUP INC	23,960	91.61	2,194,975.60
XCEL ENERGY INC	43,741	67.26	2,942,019.66
ADVANCED MICRO DEVICES	127,756	80.08	10,230,700.48
ANALOG DEVICES	40,091	193.83	7,770,838.53
APPLIED MATERIALS	68,040	115.39	7,851,135.60
BROADCOM INC	31,635	600.54	18,998,082.90
ENPHASE ENERGY INC	11,020	202.80	2,234,856.00
ENTEGRIS INC	12,483	87.03	1,086,395.49

	FIRST SOLAR INC	7,921	165.01	1,307,044.21	
	INTEL CORP	325,216	28.20	9,171,091.20	
	KLA CORP	10,991	392.83	4,317,594.53	
	LAM RESEARCH CORP	10,752	501.33	5,390,300.16	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	65,557	45.69	2,995,299.33	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,289	84.64	3,748,620.96	
	MICRON TECHNOLOGY	86,632	60.05	5,202,251.60	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	513.37	1,812,709.47	
	NVIDIA CORP	196,006	220.02	43,125,240.12	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	20,458	191.23	3,912,183.34	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	34,468	84.13	2,899,792.84	
	QORVO INC	8,556	104.44	893,588.64	
	QUALCOMM	87,829	130.16	11,431,822.64	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	119.21	1,594,076.12	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,156	314.94	1,308,890.64	
	TERADYNE INC	12,318	106.30	1,309,403.40	
	TEXAS INSTRUMENTS	71,436	176.08	12,578,450.88	
	WOLFSPEED INC	10,256	80.79	828,582.24	
	アメリカドル 小計	26,868,465		2,791,886,728.48 (375,229,576,307)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	54,860	15.53	851,975.80	
	CAMECO CORP	31,793	38.73	1,231,342.89	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	87,954	78.68	6,920,220.72	
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	24.85	2,765,631.05	
	ENBRIDGE	159,030	52.71	8,382,471.30	
	IMPERIAL OIL	16,488	69.21	1,141,134.48	
	KEYERA CORP	18,607	31.15	579,608.05	
	PARKLAND CORP	14,075	30.47	428,865.25	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	46.50	2,123,469.00	
	SUNCOR ENERGY	109,226	45.67	4,988,351.42	
	TC ENERGY CORP	78,423	57.05	4,474,032.15	
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	62.13	1,553,809.17	
	AGNICO EAGLE MINES	36,354	66.35	2,412,087.90	
	BARRICK GOLD CORP	133,727	22.80	3,048,975.60	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	60.84	799,376.76	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,360	26.78	1,161,180.80	

FRANCO-NEVADA CORP	15,363	181.44	2,787,462.72
IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	12.58	652,235.26
KINROSS GOLD CORP	108,451	5.29	573,705.79
LUNDIN MINING CORP	62,243	8.92	555,207.56
NUTRIEN LTD	41,509	104.88	4,353,463.92
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	21.83	401,912.13
TECK RESOURCES LTD-CL B	40,179	59.05	2,372,569.95
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	109.42	383,517.10
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	32,518	57.00	1,853,526.00
CAE INC	25,999	31.77	825,988.23
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,585	111.51	845,803.35
WSP GLOBAL INC	9,951	170.41	1,695,749.91
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	42.19	569,775.95
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	84.31	863,755.95
THOMSON REUTERS CORP	13,293	166.71	2,216,076.03
AIR CANADA	13,805	23.15	319,585.75
CANADIAN NATL RAILWAY CO	46,034	158.03	7,274,753.02
CP RAILWAY LIMITED	72,867	105.48	7,686,011.16
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	172.00	1,003,964.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	75.92	1,537,683.68
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	119.94	368,215.80
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	40.10	684,867.90
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	89.44	2,063,649.12
QUEBECOR INC -CL B	15,200	32.66	496,432.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	34,180	39.25	1,341,565.00
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	173.00	780,749.00
DOLLARAMA INC	22,000	79.25	1,743,500.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	65,467	64.84	4,244,880.28
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	36.80	561,310.40
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	118.43	1,529,286.59
METRO INC	18,840	71.52	1,347,436.80
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	168.86	882,462.36
SAPUTO INC	20,898	36.32	759,015.36
BANK MONTREAL	52,473	135.11	7,089,627.03
BANK NOVA SCOTIA	93,348	73.47	6,858,277.56
CANADIAN IMPERIAL BANK	69,593	62.23	4,330,772.39

NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	100.49	2,742,271.61	
ROYAL BANK OF CANADA	109,566	138.54	15,179,273.64	
TORONTO-DOMINION BANK	142,518	92.65	13,204,292.70	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	47.64	1,381,607.64	
BROOKFIELD CORP	108,921	48.45	5,277,222.45	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	19.38	631,381.02	
IGM FINANCIAL INC	7,685	42.64	327,688.40	
ONEX CORP	6,603	68.09	449,598.27	
TMX GROUP LTD	4,685	134.90	632,006.50	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,754	868.83	1,523,927.82	
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	36.13	859,460.44	
IA FINANCIAL CORP INC	10,099	89.66	905,476.34	
INTACT FINANCIAL CORP	13,255	200.51	2,657,760.05	
MANULIFE FINANCIAL CORP	154,778	27.12	4,197,579.36	
POWER CORP OF CANADA	43,577	35.87	1,563,106.99	
SUN LIFE FINANCIAL INC	44,467	68.20	3,032,649.40	
FIRSTSERVICE CORP	2,690	191.27	514,516.30	
CGI INC - CL A	16,084	124.77	2,006,800.68	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,604	2,364.70	3,792,978.80	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	101.37	707,968.08	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	44.56	191,652.56	
OPEN TEXT CORP	20,463	47.47	971,378.61	
SHOPIFY INC - CLASS A	91,833	60.39	5,545,794.87	
BCE INC	6,203	60.99	378,320.97	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	26,237	65.55	1,719,835.35	
TELUS CORP	32,908	27.29	898,059.32	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	10.46	542,016.28	
ALTAGAS INCOME LTD	24,395	24.36	594,262.20	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	39.91	450,783.45	
CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	36.30	374,761.20	
EMERA INC	23,223	54.10	1,256,364.30	
FORTIS INC	35,547	54.95	1,953,307.65	
HYDRO ONE LTD	28,888	35.72	1,031,879.36	
NORTHLAND POWER INC	17,854	33.31	594,716.74	
カナダドル 小計	3,238,747		194,808,026.74 (19,434,048,747)	

ユ一ロ	ENI	198,271	14.71	2,917,359.49
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	11.94	473,762.59
	NESTE OIL OYJ	32,766	45.14	1,479,057.24
	OMV AG	12,549	46.20	579,763.80
	REPSOL SA	111,112	15.40	1,711,680.36
	TENARIS SA	40,648	17.34	705,039.56
	TOTALENERGIES SE	195,959	59.94	11,745,782.46
	AIR LIQUIDE	41,239	148.38	6,119,042.82
	AKZO NOBEL	15,301	70.80	1,083,310.80
	ARCELORMITTAL	41,072	28.86	1,185,337.92
	ARKEMA	4,369	93.44	408,239.36
	BASF SE	73,837	52.40	3,869,058.80
	COVESTRO AG	14,454	42.55	615,017.70
	CRH PLC	60,480	44.32	2,680,473.60
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	20.14	322,985.18
	HEIDELBERGCEMENT AG	10,001	63.78	637,863.78
	KONINKLIJKE DSM NV	13,707	125.70	1,722,969.90
	OCI NV	7,248	29.98	217,295.04
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	36.16	705,264.64
	SOLVAY SA	5,356	109.35	585,678.60
	STORA ENSO OYJ R	42,169	13.65	575,606.85
	SYMRISE AG	10,018	97.08	972,547.44
	UMICORE	17,605	32.50	572,162.50
	UPM KYMMENE OYJ	42,324	34.26	1,450,020.24
	VOESTALPINE AG	7,152	34.32	245,456.64
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	15,622	27.34	427,105.48
	AIRBUS SE	46,560	124.94	5,817,206.40
	ALSTOM	24,388	27.50	670,670.00
	BOUYGUES ORD	16,606	31.75	527,240.50
	BRENTAG SE	12,514	73.80	923,533.20
	CNH INDUSTRIAL NV	81,026	15.35	1,244,154.23
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	33,494	30.98	1,037,811.59
	DASSAULT AVIATION SA	2,130	163.20	347,616.00
EIFFAGE	5,924	103.35	612,245.40	
FERROVIAL SA	37,026	27.29	1,010,439.54	
GEA GROUP AG	13,382	41.86	560,170.52	

IMCD NV	4,641	153.00	710,073.00
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	59.96	743,384.08
KNORR-BREMSE AG	5,022	63.86	320,704.92
KONE OYJ-B	26,369	48.63	1,282,324.47
LEGRAND SA	21,768	89.18	1,941,270.24
MTU AERO ENGINES AG	3,962	230.00	911,260.00
PRYSMIAN SPA	21,155	37.93	802,409.15
RATIONAL AG	483	624.50	301,633.50
RHEINMETALL AG	3,660	248.10	908,046.00
SAFRAN SA	26,468	134.10	3,549,358.80
SAINT-GOBAIN	40,093	53.09	2,128,537.37
SCHNEIDER ELECTRIC SE	42,646	156.00	6,652,776.00
SIEMENS	60,788	147.38	8,958,935.44
SIEMENS ENERGY AG	36,841	19.46	717,110.06
THALES SA	8,524	128.80	1,097,891.20
VINCI S. A.	41,377	108.60	4,493,542.20
WARTSILA OYJ	41,917	9.46	396,702.48
BUREAU VERITAS SA	25,073	26.24	657,915.52
RANDSTAD NV	10,558	58.82	621,021.56
TELEPERFORMANCE	4,734	262.60	1,243,148.40
WOLTERS KLUWER	20,644	104.60	2,159,362.40
ADP	2,382	136.45	325,023.90
AENA SME SA	5,508	141.30	778,280.40
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	9.65	437,650.63
DEUTSCHE POST AG-REG	76,659	41.15	3,154,517.85
GETLINK	35,220	16.63	585,884.70
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,705	99.24	2,650,204.20
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	91.65	457,425.15
CONTINENTAL AG	8,168	70.62	576,824.16
DR ING HC F PORSCHE AG	9,400	114.90	1,080,060.00
FERRARI NV	10,170	250.60	2,548,602.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	62,534	72.58	4,538,717.72
MICHELIN	55,356	30.17	1,670,090.52
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	56.00	657,720.00
RENAULT SA	17,362	43.56	756,375.53
STELLANTIS NV	175,794	15.90	2,795,827.77

VALEO SA	16,596	21.46	356,150.16
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,083	130.98	1,844,591.34
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	168.40	418,642.40
ADIDAS AG	13,972	144.92	2,024,822.24
HERMES INTERNATIONAL	2,516	1,741.00	4,380,356.00
KERING	5,787	596.70	3,453,102.90
LVMH	21,799	823.30	17,947,116.70
MONCLER SPA	14,541	58.16	845,704.56
PUMA SE	9,220	62.76	578,647.20
SEB SA	2,282	100.30	228,884.60
ACCOR	14,436	30.77	444,195.72
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	12,563	150.60	1,891,987.80
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	37.05	300,401.40
SODEXO	6,173	86.40	533,347.20
BOLLORE SE	83,646	5.15	430,776.90
PUBLICIS GROUPE	17,217	75.14	1,293,685.38
SCOUT24 SE	7,492	53.04	397,375.68
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	19.68	139,192.63
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	53,677	22.80	1,223,835.60
VIVENDI SE	61,243	9.80	600,426.37
D' IETEREN GROUP	2,217	186.80	414,135.60
DELIVERY HERO SE	13,414	41.74	559,900.36
INDITEX	87,326	28.47	2,486,171.22
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	21.90	341,026.80
PROSUS	64,875	74.80	4,852,650.00
ZALANDO SE	17,664	39.21	692,605.44
CARREFOUR	52,544	18.19	955,775.36
HELLOFRESH SE	13,805	22.16	305,918.80
JERONIMO MARTINS	24,901	20.24	503,996.24
KESKO OYJ-B SHS	20,083	20.07	403,065.81
KONINKLIJKE AHOLD NV	79,785	29.21	2,330,519.85
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	67,606	55.38	3,744,020.28
DANONE (GROUPE)	51,543	51.69	2,664,257.67
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	31,082	10.51	326,827.23
HEINEKEN HOLDING NV	9,251	77.80	719,727.80
HEINEKEN NV	20,157	94.28	1,900,401.96

JDE PEET' S BV	7,000	27.38	191,660.00
KERRY GROUP PLC-A	13,050	91.06	1,188,333.00
PERNOD-RICARD	16,694	195.80	3,268,685.20
REMY COINTREAU	1,382	169.10	233,696.20
BEIERSDORF AG	7,430	113.55	843,676.50
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	63.55	557,969.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	66.70	963,081.30
LOREAL	19,143	391.60	7,496,398.80
AMPLIFON SPA	11,650	28.16	328,064.00
BIOMERIEUX	3,044	98.00	298,312.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	136.65	468,709.50
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	117.85	243,949.50
ESSILORLUXOTTICA	22,662	175.55	3,978,314.10
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	37.46	636,258.10
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	28.54	961,484.06
KONINKLIJKE PHILIPS	68,755	15.97	1,098,292.37
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	50.24	1,083,526.08
ARGENX SE	4,713	346.60	1,633,525.80
BAYER	76,626	59.45	4,555,415.70
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	68.06	695,573.20
GRIFOLS SA	27,685	13.92	385,375.20
IPSEN	3,532	106.80	377,217.60
MERCK KGAA	10,555	184.10	1,943,175.50
ORION OYJ-CLASS B	9,854	45.31	446,484.74
QIAGEN N. V.	17,038	44.73	762,109.74
RECORDATI SPA	5,577	41.38	230,776.26
SANOFI	90,096	87.85	7,914,933.60
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	434.10	791,798.40
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,970	334.00	657,980.00
UCB (GROUPE)	9,389	76.48	718,070.72
ABN AMRO BANK NV-CVA	27,685	16.53	457,633.05
AIB GROUP PLC	88,299	3.98	351,959.81
BANCO BILBAO VIZCAYA	472,469	7.01	3,312,007.69
BANCO SANTANDER SA	1,306,699	3.55	4,644,008.24
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	9.81	867,341.69
BNP PARIBAS	86,613	65.80	5,699,135.40

CAIXABANK	326,789	4.08	1,334,933.06
COMMERZBANK AG	81,889	11.50	941,723.50
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	11.80	1,173,545.40
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	36.42	924,193.92
FINECOBANK SPA	53,120	16.94	900,118.40
ING GROEP NV-CVA	293,860	13.26	3,898,934.48
INTESA SANPAOLO	1,322,943	2.55	3,374,827.59
KBC GROEP NV	18,281	71.58	1,308,553.98
MEDIOBANCA	53,990	10.28	555,017.20
SOCIETE GENERALE	63,329	28.00	1,773,212.00
UNICREDIT SPA	149,896	19.42	2,911,879.69
AMUNDI SA	4,626	63.25	292,594.50
DEUTSCHE BANK NAMEN	157,109	11.86	1,863,312.74
DEUTSCHE BOERSE	14,594	171.15	2,497,763.10
EURAZEO SA	3,357	64.85	217,701.45
EURONEXT NV	6,480	77.58	502,718.40
EXOR NV	7,825	76.72	600,334.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	80.10	682,051.50
SOFINA	1,238	236.40	292,663.20
WENDEL	2,023	101.60	205,536.80
AEGON	148,741	5.21	776,130.53
AGEAS	11,086	43.85	486,121.10
ALLIANZ SE-REG	31,825	221.05	7,034,916.25
ASSICURAZIONI GENERALI	82,625	18.30	1,512,450.62
AXA SA	145,657	28.30	4,122,093.10
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	181.25	807,468.75
MUENCHENER RUECKVERSICH.	11,181	329.10	3,679,667.10
NN GROUP NV	22,611	40.93	925,468.23
POSTE ITALIANE SPA	46,035	10.23	470,938.05
SAMPO OYJ-A SHS	38,655	45.76	1,768,852.80
AROUNDTOWN SA	64,068	2.51	160,810.68
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	70.40	371,360.00
VONOVIA SE	52,580	25.28	1,329,222.40
ADYEN NV	1,746	1,461.60	2,551,953.60
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,321	57.76	2,040,140.96
BECHTLE AG	7,659	40.89	313,176.51

CAPGEMINI SA	12,468	188.55	2,350,841.40
DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	38.29	2,020,712.26
EDENRED	20,131	52.14	1,049,630.34
NEMETSCHEK SE	5,455	51.74	282,241.70
NEXI SPA	48,458	7.87	381,655.20
SAP SE	82,544	111.00	9,162,384.00
WORLDLINE SA	20,332	41.86	851,097.52
NOKIA OYJ	409,217	4.44	1,820,606.43
CELLNEX TELECOM SA	41,943	37.91	1,590,059.13
DEUTSCHE TELEKOM	256,698	20.52	5,267,442.96
ELISA A	10,227	52.52	537,122.04
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	10.37	315,140.62
KPN (KON.)	282,927	3.19	903,385.91
ORANGE	149,082	10.61	1,582,654.51
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.30	260,710.40
TELEFONICA	431,420	3.77	1,626,884.82
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.81	277,389.15
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	20.90	198,821.70
ACCIONA SA	2,181	183.30	399,777.30
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	5,437	37.30	202,800.10
E. ON SE	165,549	9.99	1,653,834.51
EDP RENOVAVEIS SA	21,466	20.04	430,178.64
ELIA GROUP SA/NV	3,125	129.00	403,125.00
ENAGAS	21,663	16.80	364,046.71
ENDESA	25,972	18.71	486,065.98
ENEL	630,812	5.37	3,389,983.68
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.63	1,046,590.90
ENGIE	145,658	13.37	1,948,030.09
FORTUM OYJ	32,550	14.43	469,696.50
IBERDROLA SA	486,473	10.83	5,268,502.59
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	26.37	263,963.70
RED ELECTRICA CORPORACION SA	30,678	16.17	496,063.26
RWE STAMM	50,344	39.11	1,968,953.84
SNAM SPA	147,559	4.79	707,250.28
TERNA SPA	98,412	7.37	726,083.73
VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,273	28.55	1,406,744.15

	VERBUND AG	6,430	79.75	512,792.50	
	ASM INTERNATIONAL NV	3,396	327.05	1,110,661.80	
	ASML HOLDING NV	32,300	623.00	20,122,900.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES	105,329	36.09	3,801,323.61	
	STMICROELECTRONICS	55,076	46.54	2,563,237.04	
	ユーロ 小計	14,500,178		378,012,528.33 (54,131,394,056)	
イギリスポンド	BP PLC	1,484,181	5.67	8,424,211.35	
	SHELL PLC-NEW	570,085	25.87	14,750,949.37	
	ANGLO AMERICAN PLC	101,345	32.61	3,305,367.17	
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	17.21	513,971.04	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	69.82	762,713.68	
	GLENORE PLC	767,868	5.07	3,896,162.23	
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	22.45	378,237.60	
	MONDI PLC	41,710	14.89	621,270.45	
	RIO TINTO PLC REG	88,610	61.39	5,439,767.90	
	ASHTREAD GROUP PLC	33,317	57.32	1,909,730.44	
	BAE SYSTEMS PLC	240,104	8.88	2,132,123.52	
	BUNZL PLC	23,700	30.72	728,064.00	
	DCC PLC	6,622	45.93	304,148.46	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	369,777	1.44	533,218.43	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	1.13	723,664.44	
	SMITHS GROUP PLC	26,476	17.77	470,610.90	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	121.15	668,021.10	
	EXPERIAN PLC	74,115	30.05	2,227,155.75	
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	44.97	624,633.30	
	RELX PLC	149,499	24.84	3,713,555.16	
	RENTOKIL INITIAL PLC	212,480	5.10	1,083,648.00	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.67	341,999.74	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,952	41.73	290,106.96	
	BURBERRY GROUP PLC	29,776	25.33	754,226.08	
	PERSIMMON PLC	25,686	14.31	367,695.09	
	TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.21	320,094.04	
	COMPASS GROUP PLC	142,427	19.09	2,718,931.43	
	ENTAIN PLC	49,630	13.94	691,842.20	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	14,811	56.70	839,783.70	

PEARSON	55,305	9.15	506,151.36
WHITBREAD PLC	17,434	31.47	548,647.98
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	6.08	440,858.80
INFORMA PLC	110,598	6.76	747,642.48
WPP PLC	85,821	10.03	861,213.73
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.83	378,593.16
KINGFISHER PLC	153,717	2.81	433,328.22
NEXT PLC	9,044	68.40	618,609.60
OCADO GROUP PLC	54,753	6.31	345,491.43
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.64	392,791.08
TESCO PLC	601,050	2.50	1,503,226.05
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	19.35	498,069.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO	169,799	31.28	5,311,312.72
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	20.67	371,233.20
DIAGEO	179,481	35.93	6,449,649.73
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	19.78	1,354,837.23
HALEON PLC	405,046	3.31	1,341,917.39
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,052	57.30	3,211,779.60
UNILEVER PLC	200,460	42.31	8,481,462.60
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	11.56	793,301.17
ASTRAZENECA	121,743	113.62	13,832,439.66
GSK PLC	318,698	14.55	4,637,055.90
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	17.75	292,058.50
BARCLAYS	1,252,105	1.74	2,186,926.59
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,575,458	6.18	9,742,632.27
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,254,644	0.52	2,781,808.53
NATWEST GROUP PLC	412,008	3.05	1,259,096.44
STANDARD CHARTERED PLC	190,159	7.59	1,443,687.12
3I GROUP PLC	74,757	16.41	1,226,762.37
ABRDN PLC	153,430	2.16	331,408.80
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	8.66	286,596.45
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	26,297	76.96	2,023,817.12
M&G PLC	229,107	2.00	458,214.00
SCHRODERS PLC	49,376	5.00	247,275.00
ST JAMES' S PLACE PLC	40,934	12.53	513,107.69
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	22.31	362,649.05

	AVIVA PLC	240,378	4.47	1,076,412.68
	LEGAL & GENERAL GROUP	490,759	2.59	1,273,519.60
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	6.35	323,856.35
	PRUDENTIAL	212,226	13.10	2,780,160.60
	SAGE GROUP PLC	76,660	7.68	589,362.08
	HALMA PLC	31,069	22.60	702,159.40
	BT GROUP PLC	607,358	1.42	863,966.75
	VODAFONE GROUP PLC	2,054,746	1.01	2,085,978.13
	NATIONAL GRID PLC	286,962	10.48	3,008,796.57
	SEVERN TRENT PLC	17,468	27.57	481,592.76
	SSE PLC	81,692	17.32	1,414,905.44
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	10.35	523,755.90
	イギリスポンド 小計	22,181,776		150,876,021.81 (24,257,846,786)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	15.95	277,498.10
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	723.50	415,289.00
	GIVAUDAN-REG	748	2,895.00	2,165,460.00
	HOLCIM LTD	44,847	56.64	2,540,134.08
	SIG GROUP AG	26,203	22.22	582,230.66
	SIKA AG-BR	11,714	264.00	3,092,496.00
	ABB LTD	122,184	31.52	3,851,239.68
	GEBERIT AG-REG	2,964	516.80	1,531,795.20
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	192.00	393,216.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	200.50	619,946.00
	VAT GROUP AG	1,956	289.20	565,675.20
	ADECCO GROUP AG-REG	9,208	34.79	320,346.32
	SGS SA	506	2,203.00	1,114,718.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	243.40	1,114,041.80
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	40,941	146.60	6,001,950.60
	SWATCH GROUP AG (BEARER)	2,483	329.70	818,645.10
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	60.60	238,642.80
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,935.00	541,800.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	103,300.00	826,400.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,280.00	842,960.00
	NESTLE SA - REGISTERED	215,571	107.90	23,260,110.90
	ALCON INC	38,399	69.22	2,657,978.78

	SONOVA HOLDING AG-REG	4,686	241.00	1,129,326.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	132.20	1,128,988.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	86.20	159,470.00	
	LONZA GROUP AG-REG	5,733	555.00	3,181,815.00	
	NOVARTIS	169,258	79.36	13,432,314.88	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	293.60	650,324.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	55,824	275.30	15,368,347.20	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	83.90	208,659.30	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	297,417	2.79	832,470.18	
	JULIUS BAER GROUP LTD	14,897	61.86	921,528.42	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	932.80	1,709,822.40	
	UBS GROUP AG	261,888	20.41	5,345,134.08	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,968	152.30	452,026.40	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	551.00	1,332,869.00	
	SWISS RE LTD	24,445	96.16	2,350,631.20	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,854	438.60	5,199,164.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	82.15	466,529.85	
	TEMENOS AG - REG	5,150	69.76	359,264.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	54.20	795,981.20	
	SWISSCOM	2,187	568.60	1,243,528.20	
	BKW AG	1,744	132.50	231,080.00	
	スイスフラン 小計	1,447,481		110,271,847.93 (15,973,979,891)	
スウェーデン ローナ	BOLIDEN AB	22,252	446.20	9,928,842.40	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	429.20	2,310,383.60	
	SCA SV CELLULOSA B	53,887	150.70	8,120,770.90	
	ALFA LAVAL AB	19,283	355.00	6,845,465.00	
	ASSA ABLOY AB-B	75,977	256.20	19,465,307.40	
	ATLAS COPCO A	207,097	126.08	26,110,789.76	
	ATLAS COPCO B	127,608	111.24	14,195,113.92	
	EPIROC AB-A	53,479	205.70	11,000,630.30	
	EPIROC AB-B	28,804	176.90	5,095,427.60	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	92.74	3,590,150.88	
	INDUTRADE AB	22,644	238.20	5,393,800.80	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	234.80	3,287,669.60	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	218.60	3,928,242.00	

	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	125.30	15,392,854.40	
	SANDVIK AB	87,644	219.30	19,220,329.20	
	SKANSKA B	25,507	194.05	4,949,633.35	
	SKF AB-B	25,671	201.70	5,177,840.70	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	218.00	2,946,052.00	
	VOLVO B	114,238	208.60	23,830,046.80	
	SECURITAS B	28,375	92.56	2,626,390.00	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	51.70	2,576,676.30	
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	128.30	2,728,812.70	
	EVOLUTION AB	15,096	1,325.00	20,002,200.00	
	EMBRACER GROUP AB	53,147	58.75	3,122,386.25	
	HENNES & MAURITZ B	55,229	129.22	7,136,691.38	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	274.30	13,570,718.20	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	234.20	4,167,823.20	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	236.80	3,394,528.00	
	NORDEA BANK ABP	258,570	128.80	33,303,816.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	131,245	128.10	16,812,484.50	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,736	108.00	13,039,488.00	
	SWEDBANK AB-A	72,526	209.00	15,157,934.00	
	EQT AB	23,207	250.00	5,801,750.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	289.90	3,426,038.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	288.70	3,224,201.60	
	INVESTOR AB-A SHS	38,925	210.70	8,201,497.50	
	INVESTOR AB-B SHS	140,493	205.00	28,801,065.00	
	KINNEVIK AB - B	18,792	165.70	3,113,834.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	494.50	3,599,960.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	54.55	3,092,985.00	
	SAGAX AB-B	17,402	259.80	4,521,039.60	
	ERICSSON (LM) B	214,689	60.91	13,076,706.99	
	HEXAGON AB-B SHS	147,005	119.80	17,611,199.00	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	93.00	4,348,866.00	
	TELIA CO AB	230,643	26.38	6,084,362.34	
	スウェーデンクローナ 小計	2,929,041		433,332,804.77 (5,563,993,213)	
ノルウェークロ ーネ	AKER BP ASA	27,755	284.80	7,904,624.00	
	EQUINOR ASA	73,436	326.00	23,940,136.00	

	NORSK HYDRO	100,517	77.26	7,765,943.42	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	467.10	5,837,815.80	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	425.00	3,674,125.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	87.70	1,676,560.90	
	MOWI ASA	31,968	174.80	5,588,006.40	
	ORKLA	69,804	69.90	4,879,299.60	
	SALMAR ASA	5,423	430.60	2,335,143.80	
	DNB BANK ASA	71,795	198.35	14,240,538.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	184.50	3,426,903.00	
	TELENOR ASA	51,193	116.10	5,943,507.30	
	ノルウェークローネ 小計	490,725		87,212,603.47 (1,139,868,727)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	502.80	4,265,252.40	
	NOVOZYMES A/S	17,111	351.30	6,011,094.30	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,729.50	1,305,772.50	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	81,654	206.55	16,865,633.70	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	15,340.00	3,359,460.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	15,570.00	6,757,380.00	
	DSV A/S	15,307	1,286.00	19,684,802.00	
	PANDORA A/S	5,783	670.40	3,876,923.20	
	CARLSBERG AS-B	6,830	988.00	6,748,040.00	
	COLOPLAST-B	9,208	812.80	7,484,262.40	
	DEMANT A/S	8,512	222.90	1,897,324.80	
	GENMAB A/S	5,250	2,747.00	14,421,750.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	130,030	969.50	126,064,085.00	
	DANSKE BANK A/S	56,132	152.90	8,582,582.80	
	TRYG A/S	29,772	155.45	4,628,057.40	
	ORSTED A/S	15,439	628.20	9,698,779.80	
	デンマーククローネ 小計	390,919		241,651,200.30 (4,644,536,069)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	31.92	658,477.68	
	SANTOS	265,406	7.01	1,860,496.06	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	29.26	404,139.12	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	147,086	35.00	5,148,010.00	
	BHP GROUP LTD	399,952	48.12	19,245,690.24	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	19.74	686,359.80	

FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,592	22.32	3,093,373.44
IGO LTD	56,345	14.05	791,647.25
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	32.49	1,200,440.52
MINERAL RESOURCES LTD	14,409	86.67	1,248,828.03
NEWCREST MINING LIMITED	73,939	23.90	1,767,142.10
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	11.38	1,156,526.64
ORICA LTD	38,288	15.95	610,693.60
PILBARA MINERALS LTD	209,485	4.69	982,484.65
RIO TINTO LTD	28,272	123.68	3,496,680.96
SOUTH32 LTD	346,773	4.66	1,615,962.18
REECE LTD	16,814	17.25	290,041.50
BRAMBLES LTD	108,007	12.22	1,319,845.54
AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.46	413,784.86
QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	6.57	558,450.00
TRANSURBAN GROUP	249,674	14.15	3,532,887.10
ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	36.35	1,679,733.50
IDP EDUCATION LTD	17,793	31.56	561,547.08
LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	5.06	920,985.78
REA GROUP LTD	3,586	128.58	461,087.88
SEEK LTD	28,001	25.26	707,305.26
WESFARMERS LTD	86,290	51.32	4,428,402.80
COLES GROUP LTD	108,486	18.24	1,978,784.64
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	6.91	759,415.91
WOOLWORTHS GROUP LTD	91,911	36.49	3,353,832.39
TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	13.84	885,206.40
COCHLEAR LIMITED	4,783	226.62	1,083,923.46
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	66.85	809,352.95
SONIC HEALTHCARE LTD	37,251	33.20	1,236,733.20
CSL LIMITED	37,924	302.99	11,490,592.76
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	236,293	24.92	5,888,421.56
COMMONWEALTH BANK OF AUST	134,440	101.50	13,645,660.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK	247,090	30.51	7,538,715.90
WESTPAC BANKING	272,224	22.76	6,195,818.24
ASX LTD	14,549	70.25	1,022,067.25
MACQUARIE GROUP LIMITED	29,094	194.11	5,647,436.34
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	4.78	796,644.36

	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.08	715,123.64	
	QBE INSURANCE GROUP	104,454	13.40	1,399,683.60	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	12.80	1,214,259.20	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	23.26	1,032,185.76	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	58.62	809,014.62	
	XERO LTD	11,340	82.41	934,529.40	
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	4.22	1,301,730.74	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	151,467	6.88	1,042,092.96	
	オーストラリアドル 小計	5,396,940		129,622,248.85 (11,951,171,343)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	8.75	721,533.75	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	26.22	1,048,275.60	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	5.28	914,063.04	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.45	416,753.85	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.49	606,886.56	
	ニュージーランドドル 小計	470,716		3,707,512.80 (310,986,173)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	213,996	47.90	10,250,408.40	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	103.10	11,031,700.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	92,000	15.30	1,407,600.00	
	MTR CORP	125,000	40.35	5,043,750.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	16.80	2,016,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	52.50	9,135,000.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	29.05	5,751,900.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	23.55	3,435,945.00	
	WH GROUP LTD	658,301	4.62	3,041,350.62	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	26.20	7,375,300.00	
	HANG SENG BANK	59,400	123.70	7,347,780.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	94,400	334.60	31,586,240.00	
	AIA GROUP LTD	931,200	85.20	79,338,240.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	50.55	8,315,272.80	
	ESR GROUP LTD	157,000	14.54	2,282,780.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	16.02	2,771,460.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	27.55	3,450,031.40	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	22.30	3,041,162.50	
	SINO LAND CO	315,400	10.30	3,248,620.00	

	SUN HUNG KAI PROPERTIES	104,500	111.10	11,609,950.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	65.65	2,658,825.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	21.10	2,029,820.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	43.85	5,393,550.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	42.85	1,606,875.00	
	CLP HOLDINGS	137,500	56.70	7,796,250.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	7.60	6,875,393.20	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	42.90	4,804,800.00	
	香港ドル 小計	5,828,053		242,646,003.92 (4,154,099,587)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	28.61	228,880.00	
	KEPPEL CORP LTD	112,800	7.13	804,264.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.65	538,010.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.85	633,742.20	
	GENTING SINGAPORE LTD	315,000	1.01	318,150.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.97	709,042.00	
	DBS GROUP	140,400	34.80	4,885,920.00	
	OCBC BANK	257,100	13.00	3,342,300.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	30.70	2,882,730.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	8.99	593,340.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.81	851,535.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	7.86	336,408.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.85	325,375.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	18.44	473,908.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	680,943	2.47	1,681,929.21	
	シンガポールドル 小計	2,447,975		18,605,533.41 (1,869,856,107)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	26.76	1,590,266.52	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	578.00	1,240,388.00	
	BANK HAPOLIM BM	98,310	30.95	3,042,694.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	30.20	3,397,862.40	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	18.34	1,824,830.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	115.40	1,442,846.20	
	AZRIELI GROUP	1,537	210.60	323,692.20	
	NICE LTD	4,991	784.40	3,914,940.40	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	176,957	5.49	971,493.93	

	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	10,000	145.20	1,452,000.00	
	イスラエルシェケル 小計	577,883		19,201,014.15 (727,128,965)	
	合 計	86,768,899		519,388,485,971 (519,388,485,971)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受 益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	83,290	897,866.20	
		LENLEASE GROUP	64,786	520,879.44	
	オーストラリアドル 小計		148,076	1,418,745.64 (130,808,348)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,111,320.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	3,307,500.00	
	香港ドル 小計		535,500	4,418,820.00 (75,650,198)	
投資信託受益証券合計			683,576	206,458,546 (206,458,546)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	2,025,611.03	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	836,629.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	36,239	7,682,668.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	811,997.42	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	2,041,119.84	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	803,554.83	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	930,267.45	
		CROWN CASTLE INC	33,305	4,654,706.80	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,431	2,644,891.28	
		EQUINIX INC	7,123	5,144,159.37	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	1,007,153.20	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	26,446	1,745,171.54	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,234,001.40	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	1,726,273.12	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,095	956,320.75	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,400	635,968.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,175,079.40	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	985,011.55			

	INVITATION HOMES INC	45,008	1,466,810.72	
	IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,240,010.16	
	KIMCO REALTY CORP	47,897	1,011,584.64	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	641,461.52	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,544,760.00	
	PROLOGIS INC	71,826	9,034,992.54	
	PUBLIC STORAGE	12,022	3,601,310.32	
	REALTY INCOME CORP	49,865	3,306,548.15	
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	808,210.60	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	2,434,052.97	
	SIMON PROPERTY GROUP	25,472	3,167,443.20	
	SUN COMMUNITIES INC	10,227	1,614,638.76	
	UDR INC	23,815	1,070,960.55	
	VENTAS INC	31,565	1,606,658.50	
	VICI PROPERTIES INC	75,143	2,561,624.87	
	WELLTOWER INC	35,075	2,737,603.75	
	WP CAREY INC	16,024	1,347,778.64	
	アメリカドル 小計	960,049	76,237,033.87 (10,246,257,352)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	244,105.65	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	343,258.40	
	カナダドル 小計	20,377	587,364.05 (58,595,437)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	312,854.10	
	GECINA SA	3,139	348,115.10	
	KLEPIERRE	17,225	408,404.75	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	627,090.90	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	383,545.80	
	ユーロ 小計	48,695	2,080,010.65 (297,857,525)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	355,854.13	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	395,036.20	
	SEGRO PLC	103,383	864,488.64	
	イギリスポンド 小計	239,086	1,615,378.97 (259,720,630)	
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	825,169.30	

		GOODMAN GROUP	133,807	2,706,915.61	
		GPT GROUP	167,884	797,449.00	
		MIRVAC GROUP	266,683	608,037.24	
		SCENTRE GROUP	381,283	1,132,410.51	
		STOCKLAND	207,412	817,203.28	
		VICINITY CENTERS	305,149	637,761.41	
	オーストラリアドル 小計		1,556,308	7,524,946.35	(693,800,053)
	香港ドル	LINK REIT	170,500	9,164,375.00	
	香港ドル 小計		170,500	9,164,375.00	(156,894,100)
	シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	787,062.26	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	338,529	649,975.68	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	470,093.74	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220,000	371,800.00	
	シンガポールドル 小計		1,125,856	2,278,931.68	(229,032,633)
投資証券合計			4,120,871	11,942,157,730	(11,942,157,730)
合計				12,148,616,276	(12,148,616,276)

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1. 通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 602 銘柄	97.3%	—	—	70.6%
	投資証券 35 銘柄	—	—	2.7%	1.9%
カナダドル	株式 86 銘柄	99.7%	—	—	3.7%
	投資証券 2 銘柄	—	—	0.3%	0.0%
ユーロ	株式 221 銘柄	99.5%	—	—	10.2%
	投資証券 5 銘柄	—	—	0.5%	0.1%
イギリスポンド	株式 77 銘柄	98.9%	—	—	4.6%

	投資証券 3 銘柄	—	—	1.1%	0.0%
スイスフラン	株式 43 銘柄	100.0%	—	—	3.0%
スウェーデンクローナ	株式 45 銘柄	100.0%	—	—	1.0%
ノルウェークローネ	株式 12 銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式 16 銘柄	100.0%	—	—	0.9%
オーストラリアドル	株式 50 銘柄	93.5%	—	—	2.2%
	投資信託受益証券 2 銘柄	—	1.0%	—	0.0%
	投資証券 7 銘柄	—	—	5.4%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 5 銘柄	100.0%	—	—	0.1%
香港ドル	株式 27 銘柄	94.7%	—	—	0.8%
	投資信託受益証券 2 銘柄	—	1.7%	—	0.0%
	投資証券 1 銘柄	—	—	3.6%	0.0%
シンガポールドル	株式 15 銘柄	89.1%	—	—	0.4%
	投資証券 4 銘柄	—	—	10.9%	0.0%
イスラエルシケル	株式 10 銘柄	100.0%	—	—	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

	2023年2月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	407,043,667
コール・ローン	7,046,609
株式	9,624,674,774
投資信託受益証券	6,208,856
投資証券	224,763,480
派生商品評価勘定	17,299,340
未収入金	1,635
未収配当金	8,483,583
差入委託証拠金	92,700,900

流動資産合計	10,388,222,844
資産合計	10,388,222,844
負債の部	
流動負債	
前受金	17,291,504
未払解約金	66,907
未払利息	1
流動負債合計	17,358,412
負債合計	17,358,412
純資産の部	
元本等	
元本	8,916,232,437
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	1,454,631,995
元本等合計	10,370,864,432
純資産合計	10,370,864,432
負債純資産合計	10,388,222,844

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年2月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るも</p>

	のであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年2月17日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		8,916,232,437口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1631円 (11,631円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年2月17日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理(流動性リスク管理等を含む)と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年2月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年2月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年2月18日
期首元本額	1,496,414,449円
期中追加設定元本額	7,511,970,961円
期中一部解約元本額	92,152,973円
期末元本額	8,916,232,437円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	174,450,525円
コア投資戦略ファンド(成長型)	414,398,493円
コア投資戦略ファンド(切替型)	180,218,852円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	105,866,103円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	5,975,380,828円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	155,144,883円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	32,144,899円
DC外国株式ESGリーダーズインデックスファンド	1,803,561,442円
FOFs用 外国株式ESGリーダーズ・インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	75,066,412円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年2月17日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	1,046,761,558
投資信託受益証券	269,545

投資証券	19,037,515
合計	1,066,068,618

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2023年2月17日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	476,550,384	—	493,841,888	17,291,504
合計		476,550,384	—	493,841,888	17,291,504

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2023年2月17日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	7,745,478	—	7,753,314	7,836
	アメリカドル	5,903,478	—	5,910,028	6,550
	オーストラリアドル	1,842,000	—	1,843,286	1,286
合計		7,745,478	—	7,753,314	7,836

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数	評価額	備考
----	----	-----	-----	----

		(株)	単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	2,854	32.26	92,070.04	
	CHENIERE ENERGY INC	659	148.80	98,059.20	
	HALLIBURTON CO	2,609	38.58	100,655.22	
	HF SINCLAIR CORP	505	53.81	27,174.05	
	KINDER MORGAN INC	5,885	18.09	106,459.65	
	MARATHON PETROLEUM CORP	1,494	126.51	189,005.94	
	ONEOK INC	1,294	69.19	89,531.86	
	PHILLIPS 66	1,384	104.92	145,209.28	
	SCHLUMBERGER	4,209	55.78	234,778.02	
	TARGA RESOURCES CORP	634	76.08	48,234.72	
	VALERO ENERGY CORP	1,173	133.97	157,146.81	
	WILLIAMS COS	3,511	32.09	112,667.99	
	AMCOR PLC	4,384	11.41	50,021.44	
	BALL CORP	934	57.39	53,602.26	
	CELANESE CORP-SERIES A	263	121.23	31,883.49	
	ECOLAB INC	741	161.99	120,034.59	
	INT'L PAPER CO	1,067	38.64	41,228.88	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	738	96.05	70,884.90	
	LINDE PLC	1,468	323.50	474,898.00	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	181	368.93	66,776.33	
	MOSAIC CO/THE	1,054	50.40	53,121.60	
	NEWMONT CORPORATION	2,291	45.85	105,042.35	
	NUCOR CORP	768	169.82	130,421.76	
	PPG INDUSTRIES INC	683	129.15	88,209.45	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	710	227.13	161,262.30	
	STEEL DYNAMICS INC	551	126.18	69,525.18	
	WESTROCK CO	621	33.09	20,548.89	
	3 M COMPANY	1,647	112.00	184,464.00	
	ALLEGION PLC	283	118.75	33,606.25	
	CARRIER GLOBAL CORP	2,450	45.23	110,813.50	
	CATERPILLAR	1,563	246.52	385,310.76	
	CUMMINS INC	407	253.97	103,365.79	
DEERE&CO	851	402.96	342,918.96		
DOVER CORP	420	154.94	65,074.80		
EATON CORP	1,146	174.11	199,530.06		

FASTENAL CO	1,665	53.02	88,278.30
FORTIVE CORP	989	68.70	67,944.30
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	438	64.49	28,246.62
GENERAC HOLDINGS INC	205	129.91	26,631.55
GRAINGER (WW) INC	133	670.09	89,121.97
IDEX CORP	222	225.09	49,969.98
ILLINOIS TOOL WORKS	894	237.48	212,307.12
INGERSOLL-RAND INC	1,181	57.39	67,777.59
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	2,005	64.45	129,222.25
LENNOX INTERNATIONAL INC	108	266.85	28,819.80
MASCO CORP	695	55.81	38,787.95
OTIS WORLDWIDE CORP	1,222	83.59	102,146.98
OWENS CORNING	236	101.68	23,996.48
PENTAIR PLC	573	56.34	32,282.82
PLUG POWER INC	1,766	15.84	27,973.44
QUANTA SERVICES INC	418	155.32	64,923.76
ROCKWELL AUTOMATION INC	336	295.88	99,415.68
SMITH (A. O.) CORP	317	67.72	21,467.24
SNAP-ON INC	157	252.45	39,634.65
TRANE TECHNOLOGIES PLC	674	184.04	124,042.96
UNITED RENTALS INC	208	462.02	96,100.16
XYLEM INC	525	106.25	55,781.25
COPART INC	1,240	68.93	85,473.20
REPUBLIC SERVICES INC	639	129.99	83,063.61
ROBERT HALF INTL INC	369	82.90	30,590.10
ROLLINS INC	740	36.18	26,773.20
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	374	103.73	38,795.02
CSX CORP	6,244	31.11	194,250.84
DELTA AIR LINES INC	457	38.28	17,493.96
EXPEDITORS INTL WASH INC	490	112.20	54,978.00
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	4,000	3.67	14,680.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	245	187.95	46,047.75
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	528	59.99	31,674.72
NORFOLK SOUTHERN CORP	685	230.02	157,563.70
OLD DOMINION FREIGHT LINE	279	351.93	98,188.47
U-HAUL HOLDING CO	207	57.70	11,943.90

UNION PACIFIC CORP	1,839	200.52	368,756.28
UNITED PARCEL SERVICE B	2,152	185.55	399,303.60
APTIV PLC	785	120.73	94,773.05
BORGWARNER INC	783	50.32	39,400.56
LEAR CORP	205	142.98	29,310.90
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	906	20.68	18,736.08
TESLA INC	7,836	202.04	1,583,185.44
HASBRO INC	452	58.46	26,423.92
LULULEMON ATHLETICA INC	336	321.83	108,134.88
NEWELL BRANDS INC	1,658	15.30	25,367.40
NIKE B	3,733	124.38	464,310.54
VF CORP	803	27.07	21,737.21
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	802	148.28	118,920.56
MCDONALD'S CORP	2,145	265.83	570,205.35
VAIL RESORTS INC	98	248.27	24,330.46
ALPHABET INC-CL A	17,601	95.51	1,681,071.51
ALPHABET INC-CL C	16,222	95.78	1,553,743.16
ELECTRONIC ARTS INC	807	111.72	90,158.04
INTERPUBLIC GROUP OF COS	1,160	37.20	43,152.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,923	4.61	8,865.03
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	471	112.52	52,996.92
THE WALT DISNEY CO	5,360	105.83	567,248.80
WARNER BROS DISCOVERY INC	6,663	15.31	102,010.53
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	772	26.40	20,380.80
ADVANCE AUTO PARTS	179	150.19	26,884.01
BEST BUY COMPANY INC	593	88.20	52,302.60
BURLINGTON STORES INC	211	226.90	47,875.90
CARMAX INC	389	74.32	28,910.48
EBAY	1,625	48.66	79,072.50
GENUINE PARTS CO	410	179.15	73,451.50
HOME DEPOT	2,997	321.24	962,756.28
LKQ CORP	787	57.90	45,567.30
LOWES COMPANIES	1,829	214.01	391,424.29
MERCADOLIBRE INC	130	1,119.64	145,553.20
POOL CORP	117	389.70	45,594.90
TARGET (DAYTON HUDSON)	1,330	174.54	232,138.20

TJX COMPANIES INC	3,360	79.62	267,523.20
TRACTOR SUPPLY COMPANY	324	236.98	76,781.52
ULTA BEAUTY INC	150	531.56	79,734.00
KROGER CO	1,998	43.85	87,612.30
BUNGE LIMITED	445	97.55	43,409.75
CAMPBELL SOUP CO (US)	623	50.89	31,704.47
COCA-COLA CO	12,074	59.22	715,022.28
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	706	56.73	40,051.38
CONAGRA BRANDS INC	1,400	35.82	50,148.00
GENERAL MILLS INC	1,732	75.11	130,090.52
HORMEL FOODS CORP	878	44.95	39,466.10
KELLOGG CO	737	66.84	49,261.08
KEURIG DR PEPPER INC	2,254	35.90	80,918.60
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	728	74.31	54,097.68
PEPSICO INC	4,053	175.51	711,342.03
CLOROX COMPANY	359	152.67	54,808.53
COLGATE-PALMOLIVE CO	2,286	72.77	166,352.22
ESTEE LAUDER CO-CL A	666	249.53	166,186.98
KIMBERLY-CLARK CORP	970	126.47	122,675.90
PROCTER & GAMBLE CO	7,007	137.14	960,939.98
ALIGN TECHNOLOGY INC	218	326.17	71,105.06
AMERISOURCEBERGEN CORP	455	160.47	73,013.85
BAXTER INTERNATIONAL	1,456	39.80	57,948.80
CARDINAL HEALTH	792	78.64	62,282.88
CIGNA CORP	909	299.43	272,181.87
DAVITA INC	138	83.42	11,511.96
DENTSPLY SIRONA INC	525	35.80	18,795.00
DEXCOM INC	1,131	117.26	132,621.06
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,787	77.28	138,099.36
ELEVANCE HEALTH INC	705	486.99	343,327.95
HCA HEALTHCARE INC	679	263.15	178,678.85
HOLOGIC INC	728	82.62	60,147.36
HUMANA INC	378	505.69	191,150.82
IDEXX LABORATORIES INC	242	506.40	122,548.80
INSULET CORP	202	298.91	60,379.82
LABORATORY CRP OF AMER	269	256.09	68,888.21

NOVOCURE LTD	339	86.64	29,370.96
QUEST DIAGNOSTICS	343	146.66	50,304.38
RESMED INC	422	213.91	90,270.02
STERIS PLC	292	191.68	55,970.56
TELEFLEX INC	114	246.35	28,083.90
AGILENT TECHNOLOGIES	861	148.28	127,669.08
AMGEN	1,569	234.22	367,491.18
BIO-TECHNE CORP	460	76.24	35,070.40
BIOGEN INC	421	271.53	114,314.13
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	539	107.29	57,829.31
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	6,272	70.85	444,371.20
CATALENT INC	500	71.89	35,945.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	1,041	13.25	13,793.25
GILEAD SCIENCES INC	3,696	83.39	308,209.44
ILLUMINA INC	453	211.82	95,954.46
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	201	146.32	29,410.32
JOHNSON & JOHNSON	7,718	158.24	1,221,296.32
LILLY (ELI) & CO	2,368	326.07	772,133.76
MERCK & CO	7,429	106.51	791,262.79
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	65	1,534.51	99,743.15
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,142	557.58	636,756.36
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	763	292.04	222,826.52
WATERS CORP	175	327.33	57,282.75
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	215	319.77	68,750.55
ZOETIS INC	1,350	173.93	234,805.50
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1,443	42.81	61,774.83
FIRST REPUBLIC BANK/CA	521	130.72	68,105.12
HUNTINGTON BANCSHARES INC	4,183	15.34	64,167.22
KEY CORP	2,724	19.08	51,973.92
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,187	158.30	187,902.10
REGIONS FINL CORP	2,716	23.66	64,260.56
SVB FINANCIAL GROUP	171	301.93	51,630.03
TRUIST FINANCIAL CORP	3,825	47.96	183,447.00
US BANCORP	4,053	48.55	196,773.15
WEBSTER FINANCIAL CORP	434	55.25	23,978.50
ALLY FINANCIAL INC	1,066	31.29	33,355.14

AMERICAN EXPRESS	1,884	177.94	335,238.96
AMERIPRISE FINANCIAL INC	317	349.47	110,781.99
BANK NEW YORK CO	2,217	51.29	113,709.93
BLACKROCK INC	434	713.00	309,442.00
CARLYLE GROUP INC/THE	485	34.81	16,882.85
CBOE GLOBAL MARKETS INC	324	126.73	41,060.52
CME GROUP INC	1,082	188.50	203,957.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	779	111.63	86,959.77
EQUITABLE HOLDINGS INC	927	32.86	30,461.22
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	114	427.17	48,697.38
FRANKLIN RESOURCES INC	1,031	31.20	32,167.20
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,605	107.13	171,943.65
INVESCO LTD	833	18.46	15,377.18
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	232	248.19	57,580.08
MARKETAXESS HOLDINGS INC	91	359.54	32,718.14
MOODY' S CORP	478	302.50	144,595.00
MORGAN STANLEY	3,858	99.57	384,141.06
NASDAQ INC	1,005	58.44	58,732.20
NORTHERN TRUST CORP	577	95.72	55,230.44
PRICE T ROWE GROUP INC	659	119.08	78,473.72
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	565	114.02	64,421.30
S&P GLOBAL INC	994	357.82	355,673.08
SCHWAB (CHARLES) CORP	4,265	80.34	342,650.10
STATE STREET CORP	1,064	93.27	99,239.28
SYNCHRONY FINANCIAL	1,464	35.65	52,191.60
AFLAC	1,764	69.13	121,945.32
ALLSTATE CORP	792	137.10	108,583.20
AMERICAN INT'L GROUP	2,281	62.16	141,786.96
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,094	67.10	73,407.40
ARTHUR J GALLAGHER & CO	605	188.63	114,121.15
ASSURANT INC	131	132.94	17,415.14
CHUBB LTD	1,222	210.26	256,937.72
HARTFORD FINANCIAL SVCS	954	77.49	73,925.46
LINCOLN NATIONAL CORP	398	34.47	13,719.06
LOEWS CORP	509	61.66	31,384.94
MARSH & MCLENNAN COS	1,484	166.51	247,100.84

PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	734	91.38	67,072.92
PROGRESSIVE CORP	1,738	142.54	247,734.52
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,081	103.11	111,461.91
TRAVELERS COS INC/THE	691	183.06	126,494.46
WILLIS TOWERS WATSON PLC	323	242.36	78,282.28
CBRE GROUP INC-A	948	88.50	83,898.00
WEYERHAEUSER CO	2,160	32.44	70,070.40
ACCENTURE PLC-CL A	1,862	281.22	523,631.64
ADOBE INC	1,375	365.16	502,095.00
ANSYS INC	253	273.24	69,129.72
AUTODESK INC	626	222.13	139,053.38
AUTOMATIC DATA PROCESS	1,203	227.48	273,658.44
CADENCE DESIGN SYSTEMS	794	194.62	154,528.28
GEN DIGITAL INC	1,758	21.35	37,533.30
HUBSPOT INC	133	361.93	48,136.69
INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,638	135.00	356,130.00
INTUIT INC	787	408.36	321,379.32
MASTERCARD INC-CLASS A	2,532	367.55	930,636.60
MICROSOFT CORP	20,730	262.15	5,434,369.50
ROPER TECHNOLOGIES INC	305	422.97	129,005.85
SALESFORCE INC	2,944	168.11	494,915.84
SERVICENOW INC	575	453.69	260,871.75
SPLUNK INC	491	107.09	52,581.19
VISA INC-CLASS A SHARES	4,803	225.83	1,084,661.49
VMWARE INC-CLASS A	611	116.26	71,034.86
WESTERN UNION CO	942	14.10	13,282.20
CISCO SYSTEMS	12,075	50.99	615,704.25
COGNEX CORP	423	55.31	23,396.13
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	3,794	16.46	62,449.24
HP INC	3,048	30.27	92,262.96
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	526	186.97	98,346.22
MOTOROLA SOLUTIONS INC	482	267.36	128,867.52
TRIMBLE IMS HOLDINGS	733	54.97	40,293.01
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	153	333.44	51,016.32
LUMEN TECHNOLOGIES INC	2,266	3.84	8,701.44
VERIZON COMMUNICATIONS	12,337	39.84	491,506.08

	AMERICAN WATER WORKS CO INC	526	147.46	77,563.96
	ATMOS ENERGY CORP	407	115.69	47,085.83
	CONSOLIDATED EDISON INC	1,023	91.66	93,768.18
	EDISON INTL	1,106	67.22	74,345.32
	ESSENTIAL UTILITIES INC	767	45.51	34,906.17
	EVERSOURCE ENERGY	998	78.72	78,562.56
	SEMPRA ENERGY	904	157.47	142,352.88
	UGI CORP	712	38.70	27,554.40
	APPLIED MATERIALS	2,497	115.39	288,128.83
	INTEL CORP	12,013	28.20	338,766.60
	LAM RESEARCH CORP	399	501.33	200,030.67
	NVIDIA CORP	7,306	220.02	1,607,466.12
	NXP SEMICONDUCTORS NV	757	191.23	144,761.11
	TEXAS INSTRUMENTS	2,684	176.08	472,598.72
	アメリカドル 小計	442,931		51,045,809.75 (6,860,556,830)
カナダドル	CAMECO CORP	1,280	38.73	49,574.40
	ENBRIDGE	6,013	52.71	316,945.23
	KEYERA CORP	573	31.15	17,848.95
	PARKLAND CORP	413	30.47	12,584.11
	PEMBINA PIPELINE CORP	1,603	46.50	74,539.50
	AGNICO EAGLE MINES	1,326	66.35	87,980.10
	IVANHOE MINES LTD-CL A	1,594	12.58	20,052.52
	KINROSS GOLD CORP	3,375	5.29	17,853.75
	LUNDIN MINING CORP	1,764	8.92	15,734.88
	NUTRIEN LTD	1,537	104.88	161,200.56
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,322	57.00	75,354.00
	CAE INC	817	31.77	25,956.09
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	211	111.51	23,528.61
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	370	84.31	31,194.70
	THOMSON REUTERS CORP	496	166.71	82,688.16
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,746	158.03	275,920.38
	MAGNA INTERNATIONAL INC	820	75.92	62,254.40
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	846	40.10	33,924.60
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	143	173.00	24,739.00
	DOLLARAMA INC	800	79.25	63,400.00

	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	2,390	64.84	154,967.60
	METRO INC	705	71.52	50,421.60
	BANK MONTREAL	1,986	135.11	268,328.46
	BANK NOVA SCOTIA	3,587	73.47	263,536.89
	NATIONAL BANK OF CANADA	976	100.49	98,078.24
	TORONTO-DOMINION BANK	5,363	92.65	496,881.95
	BROOKFIELD CORP	4,048	48.45	196,125.60
	INTACT FINANCIAL CORP	509	200.51	102,059.59
	POWER CORP OF CANADA	1,628	35.87	58,396.36
	FIRSTSERVICE CORP	103	191.27	19,700.81
	OPEN TEXT CORP	684	47.47	32,469.48
	SHOPIFY INC - CLASS A	3,546	60.39	214,142.94
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	1,039	65.55	68,106.45
	TELUS CORP	200	27.29	5,458.00
	FORTIS INC	1,389	54.95	76,325.55
	HYDRO ONE LTD	1,129	35.72	40,327.88
	NORTHLAND POWER INC	587	33.31	19,552.97
	カナダドル 小計	56,918		3,638,154.31 (362,942,273)
ユーロ	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,436	11.94	17,153.02
	NESTE OIL OYJ	1,231	45.14	55,567.34
	OMV AG	448	46.20	20,697.60
	REPSOL SA	4,227	15.40	65,116.93
	TENARIS SA	1,751	17.34	30,371.09
	TOTALENERGIES SE	7,279	59.94	436,303.26
	AIR LIQUIDE	1,551	148.38	230,137.38
	AKZO NOBEL	535	70.80	37,878.00
	CRH PLC	2,209	44.32	97,902.88
	EVONIK INDUSTRIES AG	657	20.14	13,231.98
	HEIDELBERGCEMENT AG	377	63.78	24,045.06
	KONINKLIJKE DSM NV	507	125.70	63,729.90
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	816	36.16	29,506.56
	SOLVAY SA	199	109.35	21,760.65
	STORA ENSO OYJ R	1,374	13.65	18,755.10
	SYMRISE AG	390	97.08	37,861.20
	UMICORE	562	32.50	18,265.00

UPM KYMMENE OYJ	1, 554	34. 26	53, 240. 04
VOESTALPINE AG	384	34. 32	13, 178. 88
ALSTOM	817	27. 50	22, 467. 50
BOUYGUES ORD	586	31. 75	18, 605. 50
BRENNTAG SE	392	73. 80	28, 929. 60
CNH INDUSTRIAL NV	3, 006	15. 35	46, 157. 13
EIFFAGE	291	103. 35	30, 074. 85
GEA GROUP AG	399	41. 86	16, 702. 14
IMCD NV	144	153. 00	22, 032. 00
KINGSPAN GROUP PLC	515	59. 96	30, 879. 40
MTU AERO ENGINES AG	158	230. 00	36, 340. 00
PRYSMIAN SPA	664	37. 93	25, 185. 52
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1, 607	156. 00	250, 692. 00
WARTSILA OYJ	1, 323	9. 46	12, 520. 87
BUREAU VERITAS SA	748	26. 24	19, 627. 52
RANDSTAD NV	307	58. 82	18, 057. 74
TELEPERFORMANCE	171	262. 60	44, 904. 60
WOLTERS KLUWER	760	104. 60	79, 496. 00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	959	99. 24	95, 171. 16
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	160	91. 65	14, 664. 00
MICHELIN	1, 982	30. 17	59, 796. 94
VALEO SA	653	21. 46	14, 013. 38
ADIDAS AG	502	144. 92	72, 749. 84
KERING	215	596. 70	128, 290. 50
LVMH	810	823. 30	666, 873. 00
PUMA SE	276	62. 76	17, 321. 76
SEB SA	87	100. 30	8, 726. 10
ACCOR	450	30. 77	13, 846. 50
PUBLICIS GROUPE	670	75. 14	50, 343. 80
VIVENDI SE	1, 847	9. 80	18, 107. 98
D' IETEREN GROUP	77	186. 80	14, 383. 60
DELIVERY HERO SE	453	41. 74	18, 908. 22
INDITEX	3, 161	28. 47	89, 993. 67
PROSUS	2, 387	74. 80	178, 547. 60
ZALANDO SE	550	39. 21	21, 565. 50
CARREFOUR	1, 518	18. 19	27, 612. 42

HELLOFRESH SE	519	22.16	11,501.04
JERONIMO MARTINS	863	20.24	17,467.12
KESKO OYJ-B SHS	689	20.07	13,828.23
KONINKLIJKE AHOLD NV	3,024	29.21	88,331.04
DANONE (GROUPE)	1,854	51.69	95,833.26
JDE PEET'S BV	322	27.38	8,816.36
KERRY GROUP PLC-A	466	91.06	42,433.96
BEIERSDORF AG	355	113.55	40,310.25
HENKEL AG & CO KGAA	380	63.55	24,149.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	525	66.70	35,017.50
LOREAL	721	391.60	282,343.60
AMPLIFON SPA	396	28.16	11,151.36
BIOMERIEUX	131	98.00	12,838.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	108	136.65	14,758.20
ESSILORLUXOTTICA	867	175.55	152,201.85
MERCK KGAA	375	184.10	69,037.50
ORION OYJ-CLASS B	270	45.31	12,233.70
BANCO BILBAO VIZCAYA	17,295	7.01	121,237.95
BNP PARIBAS	3,334	65.80	219,377.20
COMMERZBANK AG	2,731	11.50	31,406.50
ING GROEP NV-CVA	10,739	13.26	142,485.05
INTESA SANPAOLO	47,745	2.55	121,797.49
KBC GROEP NV	838	71.58	59,984.04
SOCIETE GENERALE	2,317	28.00	64,876.00
DEUTSCHE BOERSE	548	171.15	93,790.20
ALLIANZ SE-REG	1,207	221.05	266,807.35
AXA SA	5,380	28.30	152,254.00
NN GROUP NV	822	40.93	33,644.46
SAMPO OYJ-A SHS	1,390	45.76	63,606.40
LEG IMMOBILIEN SE	314	70.40	22,105.60
NEXI SPA	1,449	7.87	11,412.32
SAP SE	3,092	111.00	343,212.00
WORLDLINE SA	598	41.86	25,032.28
ELISA A	355	52.52	18,644.60
KPN (KON.)	9,816	3.19	31,342.48
ORANGE	5,809	10.61	61,668.34

	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	3,486	2.81	9,795.66
	ENEL	23,471	5.37	126,133.15
	IBERDROLA SA	18,106	10.83	196,087.98
	NATURGY ENERGY GROUP SA	460	26.37	12,130.20
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	1,048	16.17	16,946.16
	VERBUND AG	197	79.75	15,710.75
	ASML HOLDING NV	1,188	623.00	740,124.00
	ユーロ 小計	231,732		7,432,154.34 (1,064,284,501)
イギリスポンド	ANTOFAGASTA PLC	1,001	17.21	17,232.21
	CRODA INTERNATIONAL PLC	412	69.82	28,765.84
	JOHNSON MATTHEY PLC	471	22.45	10,573.95
	MONDI PLC	1,612	14.89	24,010.74
	ASHTED GROUP PLC	1,285	57.32	73,656.20
	BUNZL PLC	996	30.72	30,597.12
	DCC PLC	249	45.93	11,436.57
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	247	121.15	29,924.05
	INTERTEK GROUP PLC	554	44.97	24,913.38
	RELX PLC	5,537	24.84	137,539.08
	RENTOKIL INITIAL PLC	7,344	5.10	37,454.40
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,612	4.67	12,203.26
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	284	41.73	11,851.32
	BURBERRY GROUP PLC	1,289	25.33	32,650.37
	PERSIMMON PLC	813	14.31	11,638.09
	TAYLOR WIMPEY PLC	9,184	1.21	11,131.00
	COMPASS GROUP PLC	5,143	19.09	98,179.87
	INTERCONTINENTAL HOTELS	545	56.70	30,901.50
	PEARSON	2,682	9.15	24,545.66
	WHITBREAD PLC	510	31.47	16,049.70
	INFORMA PLC	4,350	6.76	29,406.00
	WPP PLC	3,240	10.03	32,513.40
	KINGFISHER PLC	5,110	2.81	14,405.09
	NEXT PLC	325	68.40	22,230.00
	OCADO GROUP PLC	1,843	6.31	11,629.33
	SAINSBURY (J) PLC	4,524	2.64	11,979.55
	TESCO PLC	22,008	2.50	55,042.00

	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	902	19.35	17,453.70
	COCA-COLA HBC AG-CDI	514	20.67	10,624.38
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	2,167	57.30	124,169.10
	UNILEVER PLC	7,458	42.31	315,547.98
	ASTRAZENECA	4,532	113.62	514,925.84
	GSK PLC	12,179	14.55	177,204.45
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	58,878	6.18	364,101.55
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	200,998	0.52	106,408.34
	ABRDN PLC	6,887	2.16	14,875.92
	SCHRODERS PLC	2,334	5.00	11,688.67
	ST JAMES' S PLACE PLC	1,915	12.53	24,004.52
	LEGAL & GENERAL GROUP	17,456	2.59	45,298.32
	PRUDENTIAL	7,952	13.10	104,171.20
	BT GROUP PLC	20,577	1.42	29,270.78
	VODAFONE GROUP PLC	77,207	1.01	78,380.54
	NATIONAL GRID PLC	10,513	10.48	110,228.80
	イギリスポンド 小計	516,639		2,900,813.77 (466,392,837)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	589	15.95	9,394.55
	GIVAUDAN-REG	28	2,895.00	81,060.00
	SIKA AG-BR	421	264.00	111,144.00
	ABB LTD	4,728	31.52	149,026.56
	GEBERIT AG-REG	104	516.80	53,747.20
	ADECCO GROUP AG-REG	427	34.79	14,855.33
	SGS SA	19	2,203.00	41,857.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	160	243.40	38,944.00
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	1,560	146.60	228,696.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	6	10,280.00	61,680.00
	SONOVA HOLDING AG-REG	157	241.00	37,837.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	329	132.20	43,493.80
	LONZA GROUP AG-REG	214	555.00	118,770.00
	ROCHE HOLDING GENUSS	2,058	275.30	566,567.40
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	92	551.00	50,692.00
	SWISS RE LTD	875	96.16	84,140.00
	TEMENOS AG - REG	200	69.76	13,952.00
	スイスフラン 小計	11,967		1,705,856.84

				(247, 110, 421)
スウェーデン ローナ	BOLIDEN AB	703	446.20	313, 678. 60
	HOLMEN AB-B SHARES	294	429.20	126, 184. 80
	SCA SV CELLULOSA B	1, 564	150.70	235, 694. 80
	ALFA LAVAL AB	753	355.00	267, 315. 00
	ASSA ABLOY AB-B	2, 915	256.20	746, 823. 00
	ATLAS COPCO A	7, 773	126.08	980, 019. 84
	ATLAS COPCO B	4, 574	111.24	508, 811. 76
	EPIROC AB-A	1, 948	205.70	400, 703. 60
	EPIROC AB-B	1, 045	176.90	184, 860. 50
	HUSQVARNA AB-B SHS	1, 379	92.74	127, 888. 46
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	4, 447	125.30	557, 209. 10
	SANDVIK AB	3, 113	219.30	682, 680. 90
	SKF AB-B	1, 022	201.70	206, 137. 40
	ELECTROLUX AB-SER B	721	128.30	92, 504. 30
	HENNES & MAURITZ B	1, 899	129.22	245, 388. 78
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1, 790	274.30	490, 997. 00
	NORDEA BANK ABP	9, 852	128.80	1, 268, 937. 60
	EQT AB	1, 233	250.00	308, 250. 00
	ERICSSON (LM) B	8, 494	60.91	517, 369. 54
	TELE2 AB-B SHS	1, 519	93.00	141, 267. 00
TELIA CO AB	7, 952	26.38	209, 773. 76	
スウェーデンローナ 小計		64, 990		8, 612, 495. 74 (110, 584, 445)
ノルウェー ローネ	AKER BP ASA	1, 087	284.80	309, 577. 60
	EQUINOR ASA	2, 821	326.00	919, 646. 00
	NORSK HYDRO	4, 021	77.26	310, 662. 46
	MOWI ASA	1, 166	174.80	203, 816. 80
	ORKLA	2, 110	69.90	147, 489. 00
	SALMAR ASA	202	430.60	86, 981. 20
	DNB BANK ASA	2, 716	198.35	538, 718. 60
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	604	184.50	111, 438. 00
	TELENOR ASA	2, 114	116.10	245, 435. 40
ノルウェーローネ 小計		16, 841		2, 873, 765. 06 (37, 560, 109)
デンマーク クロ	CHR HANSEN HOLDING A/S	277	502.80	139, 275. 60

一ネ	NOVOZYMES A/S	604	351.30	212,185.20
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	2,937	206.55	606,637.35
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	8	15,340.00	122,720.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	13	15,570.00	202,410.00
	PANDORA A/S	241	670.40	161,566.40
	COLOPLAST-B	348	812.80	282,854.40
	DEMANT A/S	301	222.90	67,092.90
	GENMAB A/S	190	2,747.00	521,930.00
	NOVO NORDISK A/S-B	4,826	969.50	4,678,807.00
	ORSTED A/S	553	628.20	347,394.60
	デンマーククローネ 小計	10,298		7,342,873.45 (141,130,027)
オーストラリア ドル	SANTOS	9,410	7.01	65,964.10
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	5,471	35.00	191,485.00
	BLUESCOPE STEEL LTD	1,217	19.74	24,023.58
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	4,932	22.32	110,082.24
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	1,323	32.49	42,984.27
	MINERAL RESOURCES LTD	565	86.67	48,968.55
	NEWCREST MINING LIMITED	2,644	23.90	63,191.60
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	4,039	11.38	45,963.82
	ORICA LTD	1,151	15.95	18,358.45
	BRAMBLES LTD	4,243	12.22	51,849.46
	AURIZON HOLDINGS LTD	4,697	3.46	16,251.62
	TRANSURBAN GROUP	8,900	14.15	125,935.00
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,768	36.35	64,266.80
	IDP EDUCATION LTD	654	31.56	20,640.24
	REA GROUP LTD	235	128.58	30,216.30
	SEEK LTD	857	25.26	21,647.82
	COLES GROUP LTD	3,916	18.24	71,427.84
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	3,373	6.91	23,307.43
	COCHLEAR LIMITED	213	226.62	48,270.06
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	458	66.85	30,617.30
	SONIC HEALTHCARE LTD	1,432	33.20	47,542.40
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	8,573	24.92	213,639.16
COMMONWEALTH BANK OF AUST	4,987	101.50	506,180.50	
ASX LTD	680	70.25	47,770.00	

	MACQUARIE GROUP LIMITED	1,050	194.11	203,815.50	
	QBE INSURANCE GROUP	4,375	13.40	58,625.00	
	SUNCORP GROUP LIMITED	4,460	12.80	57,088.00	
	COMPUTERSHARE LIMITED	1,618	23.26	37,634.68	
	XERO LTD	336	82.41	27,689.76	
	TELSTRA GROUP LTD	12,031	4.22	50,770.82	
	オーストラリアドル 小計	99,608		2,366,207.30 (218,164,313)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	3,590	8.75	31,412.50	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	1,743	26.22	45,701.46	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	5,704	5.28	30,117.12	
	MERCURY NZ LTD	2,339	6.45	15,086.55	
	MERIDIAN ENERGY LTD	4,004	5.49	21,981.96	
	ニュージーランドドル 小計	17,380		144,299.59 (12,103,849)	
香港ドル	MTR CORP	4,000	40.35	161,400.00	
	WH GROUP LTD	24,000	4.62	110,880.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	11,500	26.20	301,300.00	
	HANG SENG BANK	2,000	123.70	247,400.00	
	AIA GROUP LTD	35,200	85.20	2,999,040.00	
	SINO LAND CO	10,000	10.30	103,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	1,500	65.65	98,475.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	3,800	21.10	80,180.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	2,000	42.85	85,700.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	30,000	7.60	228,000.00	
	香港ドル 小計	124,000		4,415,375.00 (75,591,220)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	4,300	7.13	30,659.00	
	SINGAPORE AIRLINES	3,900	5.85	22,815.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	3,400	30.70	104,380.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	2,400	8.99	21,576.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	7,800	3.81	29,718.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	1,300	7.86	10,218.00	
	UOL GROUP LIMITED	1,500	6.85	10,275.00	
	シンガポールドル 小計	24,600		229,641.00 (23,078,920)	

イスラエルシエケル	BANK LEUMI LE-ISRAEL	4,525	30.20	136,655.00	
イスラエルシエケル 小計		4,525		136,655.00 (5,175,029)	
合 計		1,622,429		9,624,674,774 (9,624,674,774)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	2,944	31,736.32	
		LENDLEASE GROUP	1,761	14,158.44	
	オーストラリアドル 小計		4,705	45,894.76 (4,231,496)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	11,000	115,500.00	
	香港ドル 小計		11,000	115,500.00 (1,977,360)	
投資信託受益証券合計			15,705	6,208,856 (6,208,856)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN TOWER CORPORATION	1,362	288,744.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	1,460	31,696.60	
		BOSTON PROPERTIES	362	25,835.94	
		CROWN CASTLE INC	1,244	173,861.44	
		EQUINIX INC	261	188,491.59	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	1,586	41,172.56	
		PROLOGIS INC	2,714	341,394.06	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	311	88,196.49	
		VENTAS INC	1,168	59,451.20	
		WELLTOWER INC	1,313	102,479.65	
	アメリカドル 小計		11,781	1,341,323.53 (180,273,882)	
	カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	278	13,886.10	
	カナダドル 小計		278	13,886.10 (1,385,277)	
	ユーロ	COVIVIO (FP)	156	9,835.80	
GECINA SA		121	13,418.90		
KLEPIERRE		568	13,467.28		
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		305	18,293.90		

ユーロ 小計		1,150	55,015.88 (7,878,274)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	2,274	10,189.79
	LAND SECURITIES GROUP PLC	1,803	12,653.45
	SEGRO PLC	3,574	29,885.78
イギリスポンド 小計		7,651	52,729.02 (8,477,771)
オーストラリアドル	DEXUS	2,715	23,810.55
	GOODMAN GROUP	4,901	99,147.23
	GPT GROUP	4,863	23,099.25
	MIRVAC GROUP	9,992	22,781.76
	SCENTRE GROUP	15,450	45,886.50
	STOCKLAND	6,045	23,817.30
	VICINITY CENTERS	9,869	20,626.21
オーストラリアドル 小計		53,835	259,168.80 (23,895,363)
シンガポールドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	14,785	28,387.20
シンガポールドル 小計		14,785	28,387.20 (2,852,913)
投資証券合計		89,480	224,763,480 (224,763,480)
合計			230,972,336 (230,972,336)

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1. 通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 265 銘柄	97.4%	—	—	69.6%
	投資証券 10 銘柄	—	—	2.6%	1.8%
カナダドル	株式 37 銘柄	99.6%	—	—	3.7%
	投資証券 1 銘柄	—	—	0.4%	0.0%
ユーロ	株式 96 銘柄	99.3%	—	—	10.8%

	投資証券 4 銘柄	—	—	0.7%	0.1%
イギリスポンド	株式 43 銘柄	98.2%	—	—	4.7%
	投資証券 3 銘柄	—	—	1.8%	0.1%
スイスフラン	株式 17 銘柄	100.0%	—	—	2.5%
スウェーデンクローナ	株式 21 銘柄	100.0%	—	—	1.1%
ノルウェークローネ	株式 9 銘柄	100.0%	—	—	0.4%
デンマーククローネ	株式 11 銘柄	100.0%	—	—	1.4%
オーストラリアドル	株式 30 銘柄	88.6%	—	—	2.2%
	投資信託受 2 銘柄 益証券	—	1.7%	—	0.0%
	投資証券 7 銘柄	—	—	9.7%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 5 銘柄	100.0%	—	—	0.1%
香港ドル	株式 10 銘柄	97.5%	—	—	0.8%
	投資信託受 1 銘柄 益証券	—	2.5%	—	0.0%
シンガポールドル	株式 7 銘柄	89.0%	—	—	0.2%
	投資証券 1 銘柄	—	—	11.0%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 1 銘柄	100.0%	—	—	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年2月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,930,626,049
投資証券	122,484,352,300
未収入金	69,246,650
未収配当金	936,477,267
前払金	279,593,600
差入委託証拠金	226,446,000
流動資産合計	126,926,741,866
資産合計	126,926,741,866

負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	279,593,600
未払金	227,152,162
未払解約金	179,239,605
未払利息	620
流動負債合計	685,985,987
負債合計	685,985,987
純資産の部	
元本等	
元本	62,078,472,542
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	64,162,283,337
元本等合計	126,240,755,879
純資産合計	126,240,755,879
負債純資産合計	126,926,741,866

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年2月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2023年2月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	62,078,472,542 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1 口当たり純資産額 2.0336 円 (1 万口当たり純資産額) (20,336 円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年2月17日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年2月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年2月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年2月18日
期首元本額	52,764,805,211円

期中追加設定元本額	15,271,397,421 円
期中一部解約元本額	5,957,730,090 円
期末元本額	62,078,472,542 円
期末元本額の内訳	
SBI 資産設計オープン (資産成長型)	1,750,506,627 円
SBI 資産設計オープン (分配型)	6,338,574 円
SMT J-REITインデックス・オープン	16,805,657,959 円
Jリートインデックス・オープン (SMA専用)	32,448,878,270 円
コア投資戦略ファンド (安定型)	1,403,182,278 円
コア投資戦略ファンド (成長型)	2,164,268,574 円
分散投資コア戦略ファンドA	795,726,284 円
分散投資コア戦略ファンドS	1,788,340,764 円
コア投資戦略ファンド (切替型)	1,021,696,978 円
SMT インデックスバランス・オープン	25,071,067 円
サテライト投資戦略ファンド (株式型)	247,976,186 円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,289,331 円
グローバル経済コア	268,798,141 円
SBI 資産設計オープン (つみたてNISA対応型)	13,624,658 円
コア投資戦略ファンド (切替型ワイド)	637,380,154 円
コア投資戦略ファンド (積極成長型)	129,513,928 円
My SMT J-REITインデックス (ノーロード)	329,198,622 円
10資産分散投資ファンド	22,993,712 円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS (適格機関投資家専用)	521,514,789 円
FOFs用世界成長戦略ファンド (適格機関投資家専用)	8,900,235 円
SMTAM9資産アロケーションファンド (適格機関投資家専用)	461,771,074 円
ファンドラップ運用戦略F (中庸型) (適格機関投資家専用)	88,013,798 円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05 (適格機関投資家専用)	582,399,165 円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-11 (適格機関投資家専用)	255,776,232 円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03 (適格機関投資家専用)	291,655,142 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年2月17日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		△7,845,697,623
合計		△7,845,697,623

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「J-REITインデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

投資証券関連

(2023年2月17日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
				うち1年超	
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	4,027,843,600	—	3,748,250,000	△279,593,600
合計		4,027,843,600	—	3,748,250,000	△279,593,600

(注)1.時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清

算値段で評価しております。

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	2,431	274,459,900	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,832	334,150,400	
	S O S i L A 物流リート投資法人	5,950	752,675,000	
	東海道リート投資法人	1,989	229,729,500	
	日本アコモデーションファンド投資法人	4,130	2,490,390,000	
	森ヒルズリート投資法人	14,066	2,100,053,800	
	産業ファンド投資法人	17,875	2,511,437,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	11,960	3,904,940,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	8,772	1,778,961,600	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	6,315	2,418,645,000	
	G L P 投資法人	38,608	5,571,134,400	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,720	1,747,460,000	
	日本プロロジスリート投資法人	20,163	5,762,585,400	
	星野リゾート・リート投資法人	2,092	1,564,816,000	
	O n e リート投資法人	2,086	500,014,200	
	イオンリート投資法人	13,731	1,989,621,900	
	ヒューリックリート投資法人	11,191	1,717,818,500	
	日本リート投資法人	3,885	1,266,510,000	
	積水ハウス・リート投資法人	35,944	2,512,485,600	
	トーセイ・リート投資法人	2,653	343,032,900	
	ケネディクス商業リート投資法人	5,200	1,253,200,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	2,949	489,534,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	3,111	337,232,400	
野村不動産マスターファンド投資法人	38,682	5,910,609,600		
いちごホテルリート投資法人	1,982	230,704,800		

ラサールロジポート投資法人	14,643	2,266,736,400	
スターアジア不動産投資法人	14,935	799,022,500	
マリモ地方創生リート投資法人	1,827	226,182,600	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,725	2,088,450,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,931	124,742,600	
投資法人みらい	14,532	639,408,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,807	354,804,800	
三菱地所物流リート投資法人	4,110	1,646,055,000	
CREロジスティクスファンド投資法人	4,633	792,243,000	
ザイマックス・リート投資法人	1,940	224,652,000	
タカラレーベン不動産投資法人	5,239	483,035,800	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	5,214	708,582,600	
日本ビルファンド投資法人	13,954	7,856,102,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	11,962	6,710,682,000	
日本都市ファンド投資法人	60,354	6,180,249,600	
オリックス不動産投資法人	23,834	4,378,305,800	
日本プライムリアルティ投資法人	8,180	2,899,810,000	
NTT都市開発リート投資法人	11,498	1,514,286,600	
東急リアル・エステート投資法人	8,020	1,521,394,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	8,802	946,215,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	26,758	4,013,700,000	
森トラスト総合リート投資法人	8,549	1,193,440,400	
インヴィンシブル投資法人	52,649	2,932,549,300	
フロンティア不動産投資法人	4,438	2,216,781,000	
平和不動産リート投資法人	8,175	1,258,950,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	8,065	2,334,011,000	
福岡リート投資法人	6,186	1,026,876,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	6,960	2,168,040,000	
いちごオフィスリート投資法人	9,801	836,025,300	
大和証券オフィス投資法人	2,479	1,509,711,000	
阪急阪神リート投資法人	5,403	765,605,100	
スターツプロシード投資法人	2,073	481,557,900	
大和ハウスリート投資法人	18,031	4,992,783,900	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	38,574	3,220,929,000	
大和証券リビング投資法人	16,576	1,831,648,000	
ジャパンエクセレント投資法人	10,973	1,348,581,700	

合計	714, 147	122, 484, 352, 300
----	----------	--------------------

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年2月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	306, 657, 612
コール・ローン	184, 431, 459
投資証券	87, 755, 574, 264
派生商品評価勘定	325, 862
未収入金	9, 258, 183
未収配当金	155, 919, 858
流動資産合計	88, 412, 167, 238
資産合計	88, 412, 167, 238
負債の部	
流動負債	
未払解約金	15, 025, 072
未払利息	39
流動負債合計	15, 025, 111
負債合計	15, 025, 111
純資産の部	
元本等	
元本	35, 000, 748, 719
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	53, 396, 393, 408
元本等合計	88, 397, 142, 127
純資産合計	88, 397, 142, 127
負債純資産合計	88, 412, 167, 238

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年2月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		2023年2月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		35,000,748,719口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5256円 (25,256円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

		2023年2月17日現在
1. 金融商品に対する取組方針		当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク		当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制		運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理(流動性リスク管理等を含む)と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2023年2月17日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年2月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年2月18日
期首元本額	38,861,225,129円
期中追加設定元本額	8,255,848,808円
期中一部解約元本額	12,116,325,218円
期末元本額	35,000,748,719円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	58,177,468円
ワールド・ファイブインカム・ファンド(毎月決算型)	97,897,742円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,708,076,803円
SBI資産設計オープン(分配型)	5,326,393円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	12,395,286,722円
グローバルリートインデックス・オープン(SMA専用)	13,640,127,801円
コア投資戦略ファンド(安定型)	353,133,064円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,090,366,067円
分散投資コア戦略ファンドA	717,849,611円
分散投資コア戦略ファンドS	1,510,713,823円
コア投資戦略ファンド(切替型)	379,790,992円
SMT インデックスバランス・オープン	116,779,031円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	182,175,015円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,927,248円
グローバル経済コア	227,771,414円

SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	12,968,959 円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	345,064,516 円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	68,408,671 円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	95,199,042 円
10資産分散投資ファンド	12,708,701 円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,055,069,276 円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	188,363,343 円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	79,572,046 円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	60,546,917 円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	34,840,177 円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	98,791,022 円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	94,599,877 円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	94,112,395 円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	96,174,734 円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	95,221,524 円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	77,708,325 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年2月17日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		8,182,121,025
合計		8,182,121,025

（注）当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「グローバルREITインデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2023年2月17日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	163,553,200	—	163,879,062	325,862
	アメリカドル	163,553,200	—	163,879,062	325,862
合計		163,553,200	—	163,879,062	325,862

（注）時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	43,097	659,815.07	
		AGREE REALTY CORP	43,414	3,237,816.12	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	36,043	699,234.20	
		ALEXANDER'S INC	886	198,924.72	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	72,751	11,786,389.51	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	109,497.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	23,782	626,893.52	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	147,976	4,957,196.00	
		AMERICOLD REALTY TRUST	132,661	4,027,587.96	
		APARTMENT INCOME REIT CO	70,999	2,790,260.70	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	72,024	548,822.88	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	100,761	1,731,073.98	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	32,051	426,919.32	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	103,530.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	67,827	12,216,999.24	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,856	37,955.20	
		BOSTON PROPERTIES	68,201	4,867,505.37	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	140,343.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	81,217	534,407.86	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	146,856	3,395,310.72	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	81,949	1,507,042.11	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	105,300.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	51,702	6,206,825.10	
		CARETRUST REIT INC	45,932	948,495.80	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	11,597	304,073.34	
		CENTERSPACE	7,349	479,816.21	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,562	345,598.24	
		CITY OFFICE REIT INC	15,298	142,577.36	
CLIPPER REALTY INC	7,300	49,640.00			
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	11,050	455,812.50			
CORPORATE OFFICE PPTYS	53,219	1,389,015.90			

	COUSINS PROPERTIES INC	71,685	1,875,279.60
	CTO REALTY GROWTH INC	8,400	161,700.00
	CUBESMART	107,649	4,887,264.60
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	99,846	896,617.08
	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	178,800	108,174.00
	DIGITAL REALTY TRUST INC	139,262	15,719,894.56
	DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	93,720.32
	DOUGLAS EMMETT INC-W/I	83,212	1,303,932.04
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02
	EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	42,991	688,285.91
	EASTGROUP PROPERTIES, INC	21,324	3,548,740.08
	ELME COMMUNITIES	41,374	778,244.94
	EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	58,533	474,117.30
	EPR PROPERTIES	35,511	1,509,217.50
	EQUINIX INC	44,931	32,448,718.89
	EQUITY COMMONWEALTH	52,660	1,366,527.00
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	84,968	6,073,512.64
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	164,383	10,847,634.17
	ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	71,351	1,813,028.91
	ESSEX PROPERTY TRUST	31,552	7,480,348.16
	EXTRA SPACE STORAGE INC	65,038	10,330,635.92
	FARMLAND PARTNERS INC	22,851	287,237.07
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	35,338	3,880,819.16
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	64,739	3,495,906.00
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	42,562	1,228,339.32
	FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	128,264.67
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	124,874	6,599,590.90
	GETTY REALTY CORP	20,690	719,391.30
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	329,654.00
	GLADSTONE LAND CORP	15,061	282,393.75
	GLOBAL MEDICAL REIT INC	26,431	287,040.66
	GLOBAL NET LEASE INC	49,084	714,172.20
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	186,143	3,894,111.56
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	262,917	6,825,325.32
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	19,211	168,288.36
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	49,792	1,458,905.60

	HOST HOTELS AND RESORTS INC	348,290	6,042,831.50
	HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	61,023	636,469.89
	INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	111,216	2,109,767.52
	INDUS REALTY TRUST INC	2,340	147,771.00
	INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	158,533.48
	INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	13,242	1,158,807.42
	INVENTRUST PROPERTIES CORP	31,919	784,569.02
	INVITATION HOMES INC	279,270	9,101,409.30
	IRON MOUNTAIN INC	140,829	7,486,469.64
	ISTAR INC	40,416	348,385.92
	JBG SMITH PROPERTIES	47,111	896,522.33
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	342,700	169,636.50
	KILROY REALTY CORPORATION	52,622	2,055,941.54
	KIMCO REALTY CORP	301,675	6,371,376.00
	KITE REALTY GROUP TRUST	103,723	2,357,623.79
	LIFE STORAGE INC	41,093	5,022,386.46
	LTC PROPERTIES INC	19,175	722,130.50
	LXP INDUSTRIAL TRUST	132,496	1,483,955.20
	MACERICH CO/THE	101,670	1,305,442.80
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	835,164	233,845.92
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	293,552	3,763,336.64
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	56,339	9,464,952.00
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	88,038	4,117,537.26
	NATIONAL STORAGE AFFILIATES	40,398	1,676,517.00
	NATL HEALTH INVESTORS INC	21,139	1,238,322.62
	NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	63,086	419,521.90
	NETSTREIT CORP	27,610	535,081.80
	NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	15,490	200,750.40
	NEXPOINT RESIDENTIAL	10,806	534,788.94
	OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	22,938	403,020.66
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	115,423	3,299,943.57
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	202,506.45
	ORION OFFICE REIT INC	34,844	319,171.04
	PARAMOUNT GROUP INC	80,008	468,046.80
	PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	106,435	1,475,189.10
	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	62,226	963,880.74

	PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	55,243	1,904,226.21	
	PHYSICIANS REALTY TRUST	114,135	1,799,908.95	
	PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	58,412	599,307.12	
	PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	17,286	369,747.54	
	POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	107,380.00	
	PRIME US REIT	295,000	131,275.00	
	PROLOGIS INC	447,823	56,331,655.17	
	PUBLIC STORAGE	76,818	23,011,600.08	
	REALTY INCOME CORP	304,900	20,217,919.00	
	REGENCY CENTERS CORP	75,217	4,859,018.20	
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	58,955	868,407.15	
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	88,507	5,474,157.95	
	RLJ LODGING TRUST	77,042	889,064.68	
	RPT REALTY	37,359	404,971.56	
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	27,309	2,470,645.23	
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	109,335	1,426,821.75	
	SAFEHOLD INC	11,428	369,124.40	
	SAUL CENTERS INC	6,846	282,945.18	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	78,173	822,379.96	
	SIMON PROPERTY GROUP	158,946	19,764,935.10	
	SITE CENTERS CORP	88,151	1,218,246.82	
	SL GREEN REALTY CORP	30,439	1,175,554.18	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	68,847	3,041,660.46	
	STAG INDUSTRIAL INC	88,337	3,101,512.07	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	52,970	423,760.00	
	SUN COMMUNITIES INC	59,918	9,459,853.84	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	100,505	1,035,201.50	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	49,407	915,017.64	
	TERRENO REALTY CORP	33,191	2,113,602.88	
	UDR INC	148,930	6,697,382.10	
	UMH PROPERTIES INC	25,129	447,296.20	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,281	350,542.61	
	URBAN EDGE PROPERTIES	55,595	883,960.50	
	URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	272,856.50	
	VENTAS INC	193,249	9,836,374.10	

	VERIS RESIDENTIAL INC	37,510	617,789.70
	VICI PROPERTIES INC	468,653	15,976,380.77
	VORNADO REALTY TRUST	76,257	1,717,307.64
	WELLTOWER INC	229,859	17,940,494.95
	WHITESTONE REIT	23,074	234,893.32
	WP CAREY INC	99,817	8,395,607.87
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	54,132	768,133.08
	アメリカドル 小計	12,507,952	504,141,074.05 (67,756,560,352)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	29,679	850,600.14
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	286,921.80
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	148,440.00
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,093	649,938.87
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	9,500	187,150.00
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	76,000.00
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	39,175	1,956,791.25
	CHOICE PROPERTIES REIT	76,025	1,112,245.75
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	428,952.78
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	447,839.50
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	59,149	866,532.85
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	228,030.00
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	23,900	86,279.00
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	49,695	889,540.50
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,334	1,288,056.00
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	61,841	810,735.51
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,700	39,237.00
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	33,790	495,699.30
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,096	535,948.32
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	179,487.00
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	6,956	129,451.16
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	16,015	176,325.15
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	48,099	466,079.31
	PRIMARIS REIT	22,050	337,365.00

	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	16,000	101,600.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	70,377	1,559,554.32
	SLATE GROCERY REIT	11,024	163,375.68
	SLATE OFFICE REI	17,000	75,480.00
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	35,154	966,735.00
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	45,062	1,045,438.40
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	156,864.00
	カナダドル 小計	902,071	16,742,693.59 (1,670,251,112)
ユーロ	AEDIFICA	18,867	1,515,963.45
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	7,200	56,304.00
	ALTAREA	1,959	249,576.60
	CARE PROPERTY INVEST	17,887	253,995.40
	CARMILA	26,392	371,599.36
	COFINIMMO	14,199	1,216,144.35
	COVIVIO(FP)	21,972	1,385,334.60
	CROMWELL REIT EUR	170,400	284,568.00
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	20,490	476,187.60
	GECINA SA	26,546	2,943,951.40
	HAMBORNER REIT AG	37,000	280,830.00
	ICADE	15,570	691,930.80
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	93,598.30
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	141,272	955,705.08
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	240,548.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	210,000	246,120.00
	KLEPIERRE	92,974	2,204,413.54
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	159,630.00
	MERCIALYS	36,384	367,842.24
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	157,888	1,432,044.16
	MONTEA NV	5,994	464,535.00
	NSI NV	7,359	175,880.10
	RETAIL ESTATES	5,335	352,643.50
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	51,298	3,076,854.04
	VASTNED RETAIL	10,650	238,027.50
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	75,818	2,251,794.60
	WERELDHAVE NV	17,553	259,784.40

	XIOR STUDENT HOUSING NV	12,191	371,825.50
	ユーロ 小計	1,283,088	22,617,631.52 (3,238,844,833)
イギリスポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	123,848	80,625.04
	AEW UK REIT PLC	68,000	68,000.00
	ASSURA PLC	1,520,809	806,789.17
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	378,400	315,207.20
	BIG YELLOW GROUP PLC	87,773	1,126,127.59
	BRITISH LAND CO PLC	466,482	2,090,305.84
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	412,702	517,941.01
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	330,067	205,631.74
	CLS HOLDINGS PLC	75,636	117,992.16
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT	234,276	215,533.92
	DERWENT LONDON PLC	53,156	1,391,624.08
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT	110,000	72,160.00
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	268,056.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	123,463	701,887.15
	HAMMERSON PLC	1,923,256	576,592.14
	HOME REIT PLC	374,236	142,396.79
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	162,293	164,565.10
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	368,654	2,587,213.77
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	464,236	893,190.06
	LXI REIT PLC	811,588	946,311.60
	NEWRIVER REIT PL	126,000	116,550.00
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	268,000	209,040.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	630,955	694,681.45
	PRS REIT PLC/THE	260,002	236,081.81
	REGIONAL REIT LTD	222,000	134,310.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	105,896	1,124,615.52
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	215,000	101,695.00
	SEGRO PLC	584,939	4,891,259.91
	SHAFTESBURY PLC	139,823	591,451.29
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	589,189	564,443.06
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	113,027.01

	TRITAX BIG BOX REIT PLC	888,708	1,360,611.94	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	405,972	224,502.51	
	UNITE GROUP PLC	199,334	1,976,396.61	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	223,421	312,789.40	
	WAREHOUSE REIT PLC	177,691	193,327.80	
	WORKSPACE GROUP PLC	65,316	334,091.34	
	イギリスポンド 小計	14,222,367	26,476,295.01 (4,256,858,711)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	194,329	594,646.74	
	ARENA REIT	161,278	625,758.64	
	BWP TRUST	228,066	905,422.02	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	348,575	669,264.00	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	255,476	886,501.72	
	CENTURIA OFFICE REIT	174,739	290,066.74	
	CHARTER HALL GROUP	231,479	3,486,073.74	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	330,964	1,545,601.88	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	244,874	1,011,329.62	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	157,784	526,998.56	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	669,440	488,691.20	
	DEXUS	524,046	4,595,883.42	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	357,080.00	
	GDI PROPERTY GROUP	185,597	150,333.57	
	GOODMAN GROUP	831,119	16,813,537.37	
	GPT GROUP	933,749	4,435,307.75	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	138,810	476,118.30	
	HEALTHCO REIT	137,130	211,865.85	
	HMC CAPITAL LTD	92,191	427,766.24	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	734,103	969,015.96	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	77,706	285,181.02	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	173,646	810,926.82	
	MIRVAC GROUP	1,928,916	4,397,928.48	
	NATIONAL STORAGE REIT	553,590	1,334,151.90	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	190,640	154,418.40	
	REGION RE GROUP	528,421	1,368,610.39	
	RURAL FUNDS GROUP	181,331	442,447.64	
	SCENTRE GROUP	2,506,991	7,445,763.27	

	STOCKLAND	1,165,890	4,593,606.60	
	VICINITY CENTERS	1,892,162	3,954,618.58	
	WAYPOINT REIT LTD	336,956	926,629.00	
	オーストラリアドル 小計	16,222,998	65,181,545.42 (6,009,738,487)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	417,278	473,610.53	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	498,199	1,066,145.86	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	743,753	714,002.88	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	651,295	849,939.97	
	STRIDE PROPERTY GROUP	300,000	432,000.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	181,387	449,839.76	
	ニュージーランドドル 小計	2,791,912	3,985,539.00 (334,307,011)	
香港ドル	CHAMPION REIT	927,000	3,309,390.00	
	FORTUNE REIT	735,000	4,924,500.00	
	LINK REIT	1,012,000	54,395,000.00	
	PROSPERITY REIT	752,000	1,707,040.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	1,935,450.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,000,660	2,601,716.00	
	香港ドル 小計	4,987,660	68,873,096.00 (1,179,107,403)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	365,750.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,636,818	4,533,985.86	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	947,977	995,375.85	
	CAPITALAND CHINA TRUST	553,921	631,469.94	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,447,644	4,699,476.48	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	397,900	505,333.00	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	328,400	205,250.00	
	EC WORLD REIT	180,000	81,900.00	
	ESR-LOGOS REIT	2,708,564	947,997.40	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	356,400.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	147,977.50	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	529,862	1,133,904.68	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	1,364,796	1,719,642.96	

		KEPPEL DC REIT	626,303	1,271,395.09	
		KEPPEL REIT	936,300	856,714.50	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	883,950	609,925.50	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	986,063	2,307,387.42	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,583,885	2,629,249.10	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	1,090,073	1,842,223.37	
		QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,273,644	433,038.96	
		PARAGON REIT	519,600	498,816.00	
		PARKWAY LIFE REAL ESTATE	197,500	791,975.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	244,035.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	663,000	358,020.00	
		SUNTEC REIT	1,060,900	1,474,651.00	
		シンガポールドル 小計	22,566,000	29,641,894.61 (2,979,010,408)	
	韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240	101,946,400.00	
		E KOCREF CR-REIT CO LTD	13,200	68,772,000.00	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	81,340	337,967,700.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	56,715,120.00	
		JR REIT XXVII	76,683	343,923,255.00	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	25,433	131,742,940.00	
		LOTTE REIT CO LTD	72,480	282,309,600.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	179,101,500.00	
		NH ALL-ONE REIT CO LTD	14,949	53,592,165.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	36,380	244,837,400.00	
		SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	14,201	56,164,955.00	
		SK REITS CO LTD	39,229	205,167,670.00	
		韓国ウォン 小計	456,338	2,062,240,705.00 (214,473,033)	
	イスラエルシェケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	360,000	552,960.00	
		REIT 1 LTD	103,500	1,650,825.00	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	115,000	870,550.00	
		イスラエルシェケル 小計	578,500	3,074,335.00 (116,422,914)	
		合計	76,518,886	87,755,574,264 (87,755,574,264)	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1. 通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 145 銘柄	100.0%	77.2%
カナダドル	投資証券 31 銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 28 銘柄	100.0%	3.7%
イギリスポンド	投資証券 38 銘柄	100.0%	4.9%
オーストラリアドル	投資証券 31 銘柄	100.0%	6.8%
ニュージーランドドル	投資証券 6 銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 6 銘柄	100.0%	1.3%
シンガポールドル	投資証券 25 銘柄	100.0%	3.4%
韓国ウォン	投資証券 12 銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券 3 銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)

貸借対照表

	2023年2月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	26,531,973
コール・ローン	42,886,186
投資信託受益証券	32,049,320,459
流動資産合計	32,118,738,618
資産合計	32,118,738,618
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,147,095,981
未払金	12,554,352

未払解約金	2,949,999
未払利息	9
流動負債合計	1,162,600,341
負債合計	1,162,600,341
純資産の部	
元本等	
元本	25,393,569,450
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	5,562,568,827
元本等合計	30,956,138,277
純資産合計	30,956,138,277
負債純資産合計	32,118,738,618

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年2月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年2月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	25,393,569,450口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.2191円 (1万口当たり純資産額) (12,191円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年2月17日現在

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年2月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年2月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年2月18日
期首元本額	21,395,733,413円
期中追加設定元本額	9,819,437,551円

期中一部解約元本額	5,821,601,514 円
期末元本額	25,393,569,450 円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,415,867,067 円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,714,459,383 円
分散投資コア戦略ファンドA	2,163,979,134 円
分散投資コア戦略ファンドS	7,128,711,095 円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,673,739,703 円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	517,627,891 円
グローバル経済コア	1,295,276,633 円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	3,764,402,306 円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	867,992,469 円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	176,675,681 円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	573,452,012 円
SMT AM9 資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	1,011,922,340 円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	89,463,736 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年2月17日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資信託受益証券	1,390,171,909	
合計	1,390,171,909	

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2023年2月17日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	売建	31,166,987,470	—	32,314,083,451	△1,147,095,981
	アメリカドル	31,166,987,470	—	32,314,083,451	△1,147,095,981
合計		31,166,987,470	—	32,314,083,451	△1,147,095,981

(注) 時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

① 計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

② 計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES GOLD TRUST	6,844,495	238,462,205.80	
	アメリカドル 小計		6,844,495	238,462,205.80 (32,049,320,459)	
合計			6,844,495	32,049,320,459 (32,049,320,459)	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1. 通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資信託 受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資信託受益証券1銘柄	100.0%	100.0%

(注) 時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド

貸借対照表

	2023年2月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	606,175,008
社債券	39,828,887,070
流動資産合計	40,435,062,078
資産合計	40,435,062,078
負債の部	

流動負債	
未払解約金	260,507
未払利息	128
流動負債合計	260,635
負債合計	260,635
純資産の部	
元本等	
元本	40,079,354,802
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	355,446,641
元本等合計	40,434,801,443
純資産合計	40,434,801,443
負債純資産合計	40,435,062,078

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年2月17日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年2月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	40,079,354,802 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.0089円 (1万口当たり純資産額) (10,089円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年2月17日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理(流動性リスク管理等を含む)と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年2月17日現在
--	--------------

1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありませぬ。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありませぬ。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年2月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年2月18日
期首元本額	42,386,122,270円
期中追加設定元本額	2,415,752,180円
期中一部解約元本額	4,722,519,648円
期末元本額	40,079,354,802円
期末元本額の内訳	
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	303,829,513円
ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(SMA専用)	570,142,764円
ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	19,638,313,076円
FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	19,001,696,024円
FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンドS(適格機関投資家専用)	565,373,425円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年2月17日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
社債券		187,176,650
合計		187,176,650

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありませぬ。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	SIGNUM GENEVA1 0% 12/15/25	38,873,000,000	39,828,887,070	
合計		38,873,000,000	39,828,887,070	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

米国株式LSマザーファンド

貸借対照表

	2023年2月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,100,252,947
社債券	19,709,984,448
流動資産合計	20,810,237,395
資産合計	20,810,237,395
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	628,352,400
未払解約金	236,036
未払利息	233
流動負債合計	628,588,669
負債合計	628,588,669
純資産の部	
元本等	
元本	18,894,924,082
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	1,286,724,644
元本等合計	20,181,648,726
純資産合計	20,181,648,726
負債純資産合計	20,810,237,395

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年2月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年2月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	18,894,924,082 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.0681 円 (1万口当たり純資産額) (10,681 円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年2月17日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理(流動性リスク管理等を含む)と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年2月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年2月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年2月18日
期首元本額	18,137,161,748円
期中追加設定元本額	5,210,850,796円
期中一部解約元本額	4,453,088,462円
期末元本額	18,894,924,082円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,458,829,414円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,893,246,232円
コア投資戦略ファンド(切替型)	913,508,993円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	267,116,183円
ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	12,989,314,449円
米国株式LSファンド(SMA専用)	385,268,567円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	384,407,339円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	78,652,766円
FOFs用米国株式LSファンドS(適格機関投資家専用)	524,580,139円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年2月17日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
社債券	725,584,205	
合計	725,584,205	

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「米国株式L S マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

通貨関連

(2023年2月17日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	18,260,416,500	—	18,888,768,900	△628,352,400
	アメリカドル	18,260,416,500	—	18,888,768,900	△628,352,400
合計		18,260,416,500	—	18,888,768,900	△628,352,400

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

- ①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。
- ②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	アメリカドル	STAR HELIOS 004 10/18/27	123,000,000.00	146,651,670.00	
	アメリカドル 小計		123,000,000.00	146,651,670.00 (19,709,984,448)	
合計				19,709,984,448 (19,709,984,448)	

有価証券明細表注記

1. 通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	社債券 1 銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

コモディティLSアルファ・マザーファンド

貸借対照表

	2023年2月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	185,611,654
社債券	24,265,356,000
流動資産合計	24,450,967,654
資産合計	24,450,967,654
負債の部	
流動負債	
未払利息	39
流動負債合計	39
負債合計	39
純資産の部	
元本等	
元本	19,485,803,008
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	4,965,164,607
元本等合計	24,450,967,615
純資産合計	24,450,967,615
負債純資産合計	24,450,967,654

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年2月17日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価してお

	ります。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
--	--

(貸借対照表に関する注記)

		2023年2月17日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	19,485,803,008 口
2.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.2548 円 (1万口当たり純資産額) (12,548 円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

		2023年2月17日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。	

2. 金融商品の時価等に関する事項

		2023年2月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年2月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年2月18日
期首元本額	18,399,737,776円
期中追加設定元本額	3,066,048,995円
期中一部解約元本額	1,979,983,763円
期末元本額	19,485,803,008円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,452,365,993円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,850,445,338円
コア投資戦略ファンド(切替型)	869,514,080円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	283,606,497円
ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	13,879,599,044円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	369,674,499円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	75,638,530円
コモディティLSアルファ・ファンド(SMA専用)	226,139,380円
FOFs用 コモディティLSアルファ・ファンドS(適格機関投資家専用)	478,819,647円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年2月17日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	2,345,063,000
合計	2,345,063,000

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「コモディティLSアルファ・マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	ソシエテ・ジェネラル 0% 2023/06/30	300,000,000	334,050,000	
	STAR HELIOS 0% 07/13/23	18,930,000,000	23,931,306,000	
合計		19,230,000,000	24,265,356,000	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

貸借対照表

	2023年2月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	81,495,464
社債券	8,274,028,000
流動資産合計	8,355,523,464
資産合計	8,355,523,464
負債の部	
流動負債	
未払利息	17
流動負債合計	17
負債合計	17
純資産の部	
元本等	
元本	9,300,432,418
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	△944,908,971
元本等合計	8,355,523,447
純資産合計	8,355,523,447
負債純資産合計	8,355,523,464

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年2月17日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年2月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,300,432,418 口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 944,908,971 円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産	1口当たり純資産額 0.8984 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2023 年 2 月 17 日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023 年 2 月 17 日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023 年 2 月 17 日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022 年 2 月 18 日
期首元本額	23,299,242,162 円
期中追加設定元本額	536,858,144 円
期中一部解約元本額	14,535,667,888 円
期末元本額	9,300,432,418 円
期末元本額の内訳	

コア投資戦略ファンド（安定型）	591,407,510 円
コア投資戦略ファンド（成長型）	753,477,327 円
コア投資戦略ファンド（切替型）	356,950,564 円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	154,896,295 円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	6,405,265,191 円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	150,514,590 円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	29,802,388 円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（SMA専用）	172,119,955 円
FOFs用 米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンドS（適格機関投資家専用）	205,217,399 円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（適格機関投資家専用）	480,781,199 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年2月17日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
社債券		1,038,488,000
合計		1,038,488,000

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	STAR HELIOS 0% 10/18/23	9,220,000,000	8,274,028,000	
合計		9,220,000,000	8,274,028,000	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【中間財務諸表】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和 52 年大蔵省令第 38 号)」並びに同規則第 38 条の 3 及び第 57 条の 2 の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成 12 年総理府令第 133 号)」に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 9 期中間計算期間(2023 年 2 月 18 日から 2023 年 8 月 17 日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

2023年10月30日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 後藤知弘
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているサテライト投資戦略ファンド（株式型）の2023年2月18日から2023年8月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、サテライト投資戦略ファンド（株式型）の2023年8月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年2月18日から2023年8月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があ

ると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

-
- (注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

【サテライト投資戦略ファンド（株式型）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 (2023年2月17日現在)	第9期中間計算期間 (2023年8月17日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	272,623,265	299,659,225
投資信託受益証券	2,839,242,976	3,751,286,470
投資証券	516,765,394	785,953,531
親投資信託受益証券	5,361,287,130	4,294,393,950
流動資産合計	8,989,918,765	9,131,293,176
資産合計	8,989,918,765	9,131,293,176
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	14,163,121
未払受託者報酬	2,479,507	2,447,731
未払委託者報酬	70,914,039	70,005,056
未払利息	57	664
その他未払費用	247,890	244,717
流動負債合計	73,641,493	86,861,289
負債合計	73,641,493	86,861,289
純資産の部		
元本等		
元本	6,970,541,061	6,567,667,755
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	1,945,736,211	2,476,764,132
(分配準備積立金)	1,999,575,150	1,872,890,631
元本等合計	8,916,277,272	9,044,431,887
純資産合計	8,916,277,272	9,044,431,887
負債純資産合計	8,989,918,765	9,131,293,176

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期中間計算期間 自 2022年2月18日 至 2022年8月17日	第9期中間計算期間 自 2023年2月18日 至 2023年8月17日
営業収益		
受取配当金	2,560,239	2,256,859
受取利息	416	167
有価証券売買等損益	320,801,134	736,317,556
その他収益	-	503,685
営業収益合計	323,361,789	739,078,267
営業費用		
支払利息	22,692	69,614
受託者報酬	2,555,089	2,447,731
委託者報酬	73,075,350	70,005,056
その他費用	255,439	244,717
営業費用合計	75,908,570	72,767,118
営業利益又は営業損失(△)	247,453,219	666,311,149
経常利益又は経常損失(△)	247,453,219	666,311,149
中間純利益又は中間純損失(△)	247,453,219	666,311,149
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額(△)	△1,554,535	24,237,401
期首剰余金又は期首欠損金(△)	1,974,742,074	1,945,736,211
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,686,166	12,668,039
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	10,686,166	12,668,039
剰余金減少額又は欠損金増加額	118,638,416	123,713,866
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	118,638,416	123,713,866
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)	2,115,797,578	2,476,764,132

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

	第8期 (2023年2月17日現在)	第9期中間計算期間 (2023年8月17日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	6,970,541,061 口	6,567,667,755 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2791 円 (12,791 円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3771 円 (13,771 円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第9期中間計算期間 (2023年8月17日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第8期	第9期中間計算期間
	自 2022年2月18日 至 2023年2月17日	自 2023年2月18日 至 2023年8月17日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	7,704,434,536 円	6,970,541,061 円
期中追加設定元本額	70,367,550 円	40,261,661 円
期中一部解約元本額	804,261,025 円	443,134,967 円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

中小型株式 マザーファンド

貸借対照表

項目	2023年8月17日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	963,024,880
株式	22,573,044,500
未収入金	186,299,809
未収配当金	26,491,400
流動資産合計	23,748,860,589
資産合計	23,748,860,589
負債の部	
流動負債	
未払金	19,246,967
未払利息	2,133
流動負債合計	19,249,100
負債合計	19,249,100
純資産の部	
元本等	
元本	4,469,774,507
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	19,259,836,982
元本等合計	23,729,611,489
純資産合計	23,729,611,489
負債純資産合計	23,748,860,589

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年8月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	4,469,774,507 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 5.3089 円 (1万口当たり純資産額) (53,089 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年8月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年2月18日
期首元本額	4,573,695,116 円
期中追加設定元本額	185,425,298 円
期中一部解約元本額	289,345,907 円
期末元本額	4,469,774,507 円
期末元本額の内訳	
中小型株式オープン	2,759,057,083 円

中小型株式オープン（SMA専用）	50,222,216 円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	1,636,030,413 円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	24,464,795 円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年8月17日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,695,498,000
株式	551,698,366,410
派生商品評価勘定	5,173,250
未収配当金	804,734,355
前払金	24,194,000
差入委託証拠金	102,750,000
流動資産合計	555,330,716,015
資産合計	555,330,716,015
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	29,410,150
未払解約金	792,939,585
未払利息	5,972
流動負債合計	822,355,707
負債合計	822,355,707
純資産の部	
元本等	
元本	242,207,072,901
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	312,301,287,407
元本等合計	554,508,360,308
純資産合計	554,508,360,308
負債純資産合計	555,330,716,015

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商

	品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年 8月 17日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		242,207,072,901 口
2. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	2.2894 円 (22,894 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年 8月 17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年 8月 17日現在
----	----------------

投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年2月18日
期首元本額	258,952,777,044円
期中追加設定元本額	10,856,146,706円
期中一部解約元本額	27,601,850,849円
期末元本額	242,207,072,901円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	333,386,187円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,486,750,611円
SBI資産設計オープン(分配型)	11,982,129円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,116,608,541円
世界経済インデックスファンド	4,865,051,857円
日本株式インデックス・オープン	3,039,682,167円
DCマイセレクション25	5,509,268,445円
DCマイセレクション50	17,729,672,882円
DCマイセレクション75	18,524,505,460円
DC日本株式インデックス・オープン	6,040,396,600円
DCマイセレクションS25	3,230,130,220円
DCマイセレクションS50	9,501,855,661円
DCマイセレクションS75	8,088,930,601円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,042,061,626円
DCターゲット・イヤーフンド2025	131,436,799円
DCターゲット・イヤーフンド2035	683,077,087円
DCターゲット・イヤーフンド2045	520,896,320円
DC世界経済インデックスファンド	3,714,374,735円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	920,674,448円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	3,668,401円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	9,059,381円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	15,125,814円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	159,070,511円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,072,124円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	17,934,767円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	74,963,432円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	16,846,659円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	48,815,045円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	596,015,510円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	331,974,155円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,241,726,636円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	31,095,300円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	13,271,382円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	348,598,556円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	198,346,837円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	260,050,409円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	21,623,051円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	445,706,848円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,635,142,630円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,799,359,444円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,241,824,743円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,805,562,216円
分散投資コア戦略ファンドA	1,593,061,162円
分散投資コア戦略ファンドS	6,059,257,110円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	570,861,845円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	400,997,839円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,322,566,262円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	206,304,106円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,632,222円

SMT インデックスバランス・オープン	50,616,597 円
国内株式SMT Bセクション (SMA専用)	18,903,179,888 円
サテライト投資戦略ファンド (株式型)	285,794,619 円
SMT 世界経済インデックス・オープン	49,627,485 円
SMT 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	203,540,608 円
SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	34,885,123 円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,588,897 円
グローバル経済コア	212,216,739 円
SBI資産設計オープン (つみたてNISA対応型)	33,424,097 円
My SMT TOPIXインデックス (ノーロード)	929,462,161 円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	28,618,283 円
コア投資戦略ファンド (切替型ワイド)	980,337,953 円
コア投資戦略ファンド (積極成長型)	226,289,632 円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2030	55,833,393 円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2040	50,064,093 円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2050	20,776,312 円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2060	21,844,873 円
10資産分散投資ファンド	93,091,386 円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP (適格機関投資家専用)	42,304,728,456 円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS (適格機関投資家専用)	524,850,986 円
世界株式ファンド (適格機関投資家専用)	294,694,010 円
FOFs用世界成長戦略ファンド (適格機関投資家専用)	21,880,557 円
SMTAM9資産アロケーションファンド (適格機関投資家専用)	614,567,203 円
SMTAM日本株式インデックスファンドVLP (適格機関投資家専用)	46,062,653,335 円
私募世界経済パッシブファンド (適格機関投資家専用)	17,376,913 円
ファンドラップ運用戦略F (中庸型) (適格機関投資家専用)	203,852,529 円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2023年8月17日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,797,844,000	—	2,773,650,000	△24,194,000
合計		2,797,844,000	—	2,773,650,000	△24,194,000

(注)1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

	2023年8月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	

コール・ローン	87,184,951
株式	11,190,063,970
投資証券	146,821,300
派生商品評価勘定	449,348
未収入金	36,324
未収配当金	14,376,890
前払金	320,750
差入委託証拠金	4,092,250
流動資産合計	11,443,345,783
資産合計	11,443,345,783
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	773,728
未払解約金	2,634,488
未払利息	193
流動負債合計	3,408,409
負債合計	3,408,409
純資産の部	
元本等	
元本	9,276,550,341
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	2,163,387,033
元本等合計	11,439,937,374
純資産合計	11,439,937,374
負債純資産合計	11,443,345,783

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>

3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

	2023年8月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,276,550,341 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1 口当たり純資産額 1.2332 円 (1万口当たり純資産額) (12,332 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年8月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年2月18日
期首元本額	9,766,829,960 円
期中追加設定元本額	627,526,060 円
期中一部解約元本額	1,117,805,679 円
期末元本額	9,276,550,341 円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	206,252,795 円
コア投資戦略ファンド(成長型)	465,879,556 円

コア投資戦略ファンド（切替型）	240,510,570 円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	6,957,928,026 円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	105,416,524 円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	177,935,243 円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	37,500,556 円
DC日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスファンド	956,025,834 円
私募日本株式ESGセレクト・リーダーズパッシブファンド（適格機関投資家専用）	41,674,525 円
FOFs用 日本株式ESGセレクト・リーダーズ・インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	87,426,712 円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年8月17日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	101,795,750	—	101,475,000	△320,750
合計		101,795,750	—	101,475,000	△320,750

（注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年8月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	8,393,640,441
コール・ローン	504,214,754
株式	560,845,281,781
投資信託受益証券	175,353,491
投資証券	11,367,728,136
派生商品評価勘定	19,573,498
未収入金	461,537
未収配当金	717,030,732
前払金	140,563,399
差入委託証拠金	4,712,871,411
流動資産合計	586,876,719,180
資産合計	586,876,719,180
負債の部	
流動負債	

派生商品評価勘定	163,010,679
未払解約金	859,992,946
未払利息	1,117
流動負債合計	1,023,004,742
負債合計	1,023,004,742
純資産の部	
元本等	
元本	113,433,464,160
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	472,420,250,278
元本等合計	585,853,714,438
純資産合計	585,853,714,438
負債純資産合計	586,876,719,180

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総</p>

4. 収益及び費用の計上基準	<p>理府令第 133 号)」第 60 条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第 61 条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p> <p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>
----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

		2023 年 8 月 17 日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	113, 433, 464, 160 口
2.	計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額) 5. 1647 円 (51, 647 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

		2023 年 8 月 17 日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

	区分	2023 年 8 月 17 日現在
投資信託財産に係る元本の状況		

期首	2023年2月18日
期首元本額	121,979,552,292円
期中追加設定元本額	6,500,598,183円
期中一部解約元本額	15,046,686,315円
期末元本額	113,433,464,160円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,584,064,210円
SBI資産設計オープン(分配型)	5,440,412円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	33,993,762,745円
世界経済インデックスファンド	12,270,671,042円
外国株式インデックス・オープン	884,878,908円
DCマイセクション25	652,498,758円
DCマイセクション50	3,527,060,202円
DCマイセクション75	4,359,696,321円
DC外国株式インデックス・オープン	12,555,394,496円
DCマイセクションS25	414,470,068円
DCマイセクションS50	1,892,905,223円
DCマイセクションS75	1,869,231,740円
DCターゲット・イヤーフアンド2025	29,528,417円
DCターゲット・イヤーフアンド2035	153,554,044円
DCターゲット・イヤーフアンド2045	117,131,212円
DC世界経済インデックスファンド	9,362,432,752円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	986,984,156円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	1,777,533円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	3,528,471円
外国株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	23,420,454円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	8,128,323円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	35,548,191円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	7,702,248円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	22,324,805円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	180,550,450円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	137,664,089円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,045,814,273円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	69,652,340円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	17,797,112円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	122,396,098円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	39,965,836円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	829,639,486円
FOFs用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	901,515,701円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,125,077,954円
コア投資戦略ファンド(安定型)	113,740,322円
コア投資戦略ファンド(成長型)	283,481,970円
分散投資コア戦略ファンドA	1,536,388,239円
分散投資コア戦略ファンドS	7,718,437,187円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,436,951,103円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	999,185,155円
コア投資戦略ファンド(切替型)	133,649,708円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	513,182,694円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	24,281,684円
SMT インデックスバランス・オープン	128,328,988円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	81,452,152円
外国株式SMTBセクション(SMA専用)	4,291,568,581円
SMT 世界経済インデックス・オープン	242,734,447円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	984,098,873円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	168,823,715円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,237,060円

My SMT グローバル株式インデックス (ノーロード)	963,943,440 円
グローバル経済コア	522,903,532 円
SBI資産設計オープン (つみたてNISA対応型)	15,308,388 円
DCターゲット・イヤーフンド2055	6,443,049 円
コア投資戦略ファンド (切替型ワイド)	116,500,119 円
コア投資戦略ファンド (積極成長型)	26,636,361 円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2030	150,139,584 円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2040	136,525,421 円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2050	56,429,444 円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2060	58,766,356 円
10資産分散投資ファンド	53,273,628 円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS (適格機関投資家専用)	53,435,077 円
外株インデックス・ファンド (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用)	23,714,510 円
外株インデックス・ファンド2 (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用)	449,467,636 円
世界株式ファンド (適格機関投資家専用)	1,429,915,791 円
FOFs用世界成長戦略ファンド (適格機関投資家専用)	103,799,064 円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド (適格機関投資家専用)	68,475,569 円
私募世界経済パッシブファンド (適格機関投資家専用)	84,714,210 円
ファンドラップ運用戦略F (中庸型) (適格機関投資家専用)	70,000,285 円
SMTAM海外バランスファンド2020-01 (適格機関投資家専用)	194,200,383 円
SMTAM海外バランスファンド2020-08 (適格機関投資家専用)	186,765,260 円
SMTAM海外バランスファンド2020-11 (適格機関投資家専用)	185,818,200 円
SMTAM海外バランスファンド2021-04 (適格機関投資家専用)	189,041,134 円
SMTAM海外バランスファンド2021-07 (適格機関投資家専用)	187,171,165 円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11 (適格機関投資家専用)	85,911,878 円
SMTAM海外バランスファンド2023-02 (適格機関投資家専用)	120,414,728 円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2023年8月17日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	13,459,556,323	—	13,318,992,924	△140,563,399
	合計	13,459,556,323	—	13,318,992,924	△140,563,399

(注)1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

(2023年8月17日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	76,128,000	—	76,127,532	△468

	アメリカドル	76,128,000	—	76,127,532	△468
	売建	482,547,480	—	485,420,794	△2,873,314
	アメリカドル	364,175,000	—	366,168,250	△1,993,250
	イギリスポンド	118,372,480	—	119,252,544	△880,064
	合計	558,675,480	—	561,548,326	△2,873,782

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

	2023年8月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	346,328,376
コール・ローン	5,755,259
株式	11,015,208,094
投資信託受益証券	5,778,057
投資証券	230,722,422
派生商品評価勘定	1,669,108
未収入金	3,819
未収配当金	12,655,807
前払金	2,894,988
差入委託証拠金	110,215,507
流動資産合計	11,731,231,437
資産合計	11,731,231,437
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,543,367
未払解約金	90
未払利息	12
流動負債合計	4,543,469
負債合計	4,543,469
純資産の部	
元本等	
元本	8,611,501,940
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	3,115,186,028

元本等合計	11,726,687,968
純資産合計	11,726,687,968
負債純資産合計	11,731,231,437

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

(3)為替予約取引による為替差損益
約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年 8月 17日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		8,611,501,940 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3617 円 (13,617 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年 8月 17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年 8月 17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月 18日
期首元本額	8,916,232,437 円
期中追加設定元本額	427,840,767 円
期中一部解約元本額	732,571,264 円
期末元本額	8,611,501,940 円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド (安定型)	148,840,675 円
コア投資戦略ファンド (成長型)	368,868,172 円
コア投資戦略ファンド (切替型)	185,653,993 円
サテライト投資戦略ファンド (株式型)	96,694,266 円
外国株式SMTBセレクション (SMA専用)	5,411,041,248 円

コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	155,144,883 円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	34,192,199 円
DC 外国株式 ESG リーダーズインデックスファンド	2,143,222,713 円
FOFs 用 外国株式 ESG リーダーズ・インデックス・ファンド S（適格機関投資家専用）	67,843,791 円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023 年 8 月 17 日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	451,612,433	—	448,717,445	△2,894,988
合計		451,612,433	—	448,717,445	△2,894,988

（注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2023 年 8 月 17 日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	3,787,420	—	3,808,149	20,729
	アメリカドル	3,787,420	—	3,808,149	20,729
合計		3,787,420	—	3,808,149	20,729

（注）時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023 年 8 月 17 日現在
項目	金額 (円)

資産の部	
流動資産	
預金	4,848,106,228
コール・ローン	301,780,541
株式	149,613,822,708
投資信託受益証券	456,357,392
投資証券	130,715,460
派生商品評価勘定	14,898
未収入金	7,172,244
未収配当金	519,761,357
前払金	296,892,016
差入委託証拠金	1,017,594,793
流動資産合計	157,192,217,637
資産合計	157,192,217,637
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	296,902,137
未払金	2,852,086
未払解約金	286,916,560
未払利息	668
流動負債合計	586,671,451
負債合計	586,671,451
純資産の部	
元本等	
元本	40,572,499,666
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	116,033,046,520
元本等合計	156,605,546,186
純資産合計	156,605,546,186
負債純資産合計	157,192,217,637

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p>

	<p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		2023年8月17日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	40,572,499,666 口
2.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1 口当たり純資産額 3.8599 円 (1 万口当たり純資産額) (38,599 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

		2023年8月17日現在
1.	貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.	時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引</p>

	「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。
	(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年 8月 17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月 18日
期首元本額	36,009,544,669円
期中追加設定元本額	7,554,859,033円
期中一部解約元本額	2,991,904,036円
期末元本額	40,572,499,666円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,710,661,168円
世界経済インデックスファンド	9,402,762,544円
DC新興国株式インデックス・オープン	5,975,688,720円
DC世界経済インデックスファンド	7,138,347,484円
新興国株式インデックス・オープン (SMA専用)	102,654,695円
コア投資戦略ファンド (安定型)	50,323,436円
コア投資戦略ファンド (成長型)	125,428,063円
分散投資コア戦略ファンドA	309,401,097円
分散投資コア戦略ファンドS	1,517,431,406円
DC世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	1,106,472,731円
DC世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	770,061,961円
コア投資戦略ファンド (切替型)	59,134,295円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	395,598,044円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	18,480,820円
SMT インデックスバランス・オープン	96,978,156円
サテライト投資戦略ファンド (株式型)	35,711,445円
外国株式SMT Bセレクション (SMA専用)	1,880,561,712円
SMT 世界経済インデックス・オープン	229,840,914円
SMT 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	950,481,892円
SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	161,733,311円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,360,644円
グローバル経済コア	407,092,752円
My SMT 新興国株式インデックス (ノーロード)	184,443,703円
コア投資戦略ファンド (切替型ワイド)	51,001,497円
コア投資戦略ファンド (積極成長型)	11,615,652円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2030	96,225,804円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2040	87,094,125円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2050	35,868,670円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2060	37,048,528円

10資産分散投資ファンド	13,164,952円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,390,057,619円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	100,931,802円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	80,111,147円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	10,376,386円
FOFs用 新興国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	23,352,491円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年8月17日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	6,718,326,577	—	6,421,434,561	△296,892,016
合計		6,718,326,577	—	6,421,434,561	△296,892,016

（注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2023年8月17日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	54,008,872	—	54,023,455	14,583
	アメリカドル	54,008,872	—	54,023,455	14,583
	売建	2,768,872	—	2,778,678	△9,806
	ブラジルリアル	2,768,872	—	2,778,678	△9,806
合計		56,777,744	—	56,802,133	4,777

（注）時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年8月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,797,414,434
投資証券	136,551,402,600
派生商品評価勘定	8,359,200
未収入金	141,209,948
未収配当金	1,030,331,249
差入委託証拠金	219,816,000
流動資産合計	140,748,533,431
資産合計	140,748,533,431
負債の部	
流動負債	
前受金	8,359,200
未払金	354,908,135
未払解約金	3,810,810
未払利息	6,198
流動負債合計	367,084,343
負債合計	367,084,343
純資産の部	
元本等	
元本	66,367,477,144
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	74,013,971,944
元本等合計	140,381,449,088
純資産合計	140,381,449,088
負債純資産合計	140,748,533,431

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金

	投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年8月17日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		66,367,477,144 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	2.1152 円 (21,152 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年8月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年2月18日
期首元本額	62,078,472,542 円
期中追加設定元本額	6,648,080,899 円
期中一部解約元本額	2,359,076,297 円
期末元本額	66,367,477,144 円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,926,636,815 円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,232,029 円
SMT J-REITインデックス・オープン	16,906,055,447 円

Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	35,843,925,520 円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,403,182,278 円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,252,990,018 円
分散投資コア戦略ファンドA	1,060,652,310 円
分散投資コア戦略ファンドS	1,874,236,312 円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,065,600,194 円
SMT インデックスバランス・オープン	24,377,577 円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	256,354,957 円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,865,545 円
グローバル経済コア	272,743,817 円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,791,041 円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	672,228,737 円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	155,626,702 円
My SMT J-REITインデックス（ノーロード）	427,522,272 円
10資産分散投資ファンド	23,177,769 円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	500,860,945 円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	9,138,352 円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	504,418,156 円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	100,140,078 円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	518,954,856 円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-11（適格機関投資家専用）	250,784,140 円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	285,981,277 円

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2023年8月17日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	3,802,816,800	—	3,811,176,000	8,359,200
合計		3,802,816,800	—	3,811,176,000	8,359,200

（注）1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年8月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	584,992,116
コール・ローン	110,295,015
投資証券	91,912,577,079

派生商品評価勘定	151,487
未収入金	10,366,887
未収配当金	185,144,601
流動資産合計	92,803,527,185
資産合計	92,803,527,185
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,020
未払金	357,996,956
未払解約金	64,358,725
未払利息	244
流動負債合計	422,366,945
負債合計	422,366,945
純資産の部	
元本等	
元本	36,023,614,309
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	56,357,545,931
元本等合計	92,381,160,240
純資産合計	92,381,160,240
負債純資産合計	92,803,527,185

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

(2)為替予約取引による為替差損益
約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年 8月 17日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		36,023,614,309 円
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1 円当たり純資産額 (1 万円当たり純資産額)	2.5645 円 (25,645 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年 8月 17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年 8月 17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月 18日
期首元本額	35,000,748,719 円
期中追加設定元本額	3,002,873,984 円
期中一部解約元本額	1,980,008,394 円
期末元本額	36,023,614,309 円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	55,859,963 円
ワールド・ファイブインカム・ファンド (毎月決算型)	100,877,861 円
SBI資産設計オープン (資産成長型)	1,581,360,701 円
SBI資産設計オープン (分配型)	5,230,928 円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	12,139,984,268 円

グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	14,059,882,962 円
コア投資戦略ファンド（安定型）	353,133,064 円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,090,366,067 円
分散投資コア戦略ファンドA	1,109,821,859 円
分散投資コア戦略ファンドS	1,578,869,574 円
コア投資戦略ファンド（切替型）	510,318,247 円
SMT インデックスバランス・オープン	113,320,019 円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	176,477,358 円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,452,577 円
グローバル経済コア	231,082,612 円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	13,964,309 円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	351,309,947 円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	80,610,538 円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	141,195,359 円
10資産分散投資ファンド	12,825,323 円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,362,520,914 円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	174,141,660 円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	81,789,731 円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	57,560,119 円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	36,083,014 円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	94,617,784 円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	92,985,353 円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	92,513,618 円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	92,104,212 円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	91,193,091 円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	72,210,338 円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	59,950,939 円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2023年8月17日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	買建	37,067,200	—	37,207,667	140,467
	アメリカドル	27,677,300	—	27,828,787	151,487
	オーストラリア ドル	9,389,900	—	9,378,880	△11,020
合計		37,067,200	—	37,207,667	140,467

（注）時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2023年8月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	6,820,854
コール・ローン	186,233,631
投資信託受益証券	31,344,379,581
流動資産合計	31,537,434,066
資産合計	31,537,434,066
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	946,522,135
未払金	17,553,559
未払解約金	143,895,764
未払利息	412
流動負債合計	1,107,971,870
負債合計	1,107,971,870
純資産の部	
元本等	
元本	25,095,411,185
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	5,334,051,011
元本等合計	30,429,462,196
純資産合計	30,429,462,196
負債純資産合計	31,537,434,066

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨</p>

4. 収益及び費用の計上基準	<p>建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第 61 条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p> <p>為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>
----------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	2023 年 8 月 17 日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		25,095,411,185 口
2. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	1.2126 円 (12,126 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023 年 8 月 17 日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023 年 8 月 17 日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023 年 2 月 18 日
期首元本額	25,393,569,450 円
期中追加設定元本額	1,401,015,105 円
期中一部解約元本額	1,699,173,370 円
期末元本額	25,095,411,185 円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド (安定型)	2,323,181,016 円
コア投資戦略ファンド (成長型)	3,730,430,735 円
分散投資コア戦略ファンドA	2,114,521,968 円

分散投資コア戦略ファンドS	7,439,587,857 円
コア投資戦略ファンド (切替型)	1,758,421,008 円
サテライト投資戦略ファンド (株式型)	524,744,204 円
グローバル経済コア	1,333,882,876 円
SMT ゴールドインデックス・オープン (為替ヘッジあり)	3,425,097,786 円
コア投資戦略ファンド (切替型ワイド)	969,067,164 円
コア投資戦略ファンド (積極成長型)	220,618,257 円
F O F s 用世界成長戦略ファンド (適格機関投資家専用)	588,577,101 円
SMT AM9 資産アロケーションファンド (適格機関投資家専用)	564,017,610 円
ファンドラップ運用戦略F (中庸型) (適格機関投資家専用)	103,263,603 円

(デリバティブ取引に関する注記)

通貨関連

(2023年8月17日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	売建	30,660,379,792	—	31,606,901,927	△946,522,135
	アメリカドル	30,660,379,792	—	31,606,901,927	△946,522,135
合計		30,660,379,792	—	31,606,901,927	△946,522,135

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

- ①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。
- ②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド

貸借対照表

	2023年8月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	534,991,573
社債券	29,661,382,260
流動資産合計	30,196,373,833
資産合計	30,196,373,833
負債の部	
流動負債	
未払解約金	207,744
未払利息	1,185
流動負債合計	208,929
負債合計	208,929

純資産の部	
元本等	
元本	29,758,531,883
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	437,633,021
元本等合計	30,196,164,904
純資産合計	30,196,164,904
負債純資産合計	30,196,373,833

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年8月17日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年8月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	29,758,531,883 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.0147円 (1万口当たり純資産額) (10,147円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年8月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年8月17日現在
----	--------------

投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年2月18日
期首元本額	40,079,354,802円
期中追加設定元本額	404,013,000円
期中一部解約元本額	10,724,835,919円
期末元本額	29,758,531,883円
期末元本額の内訳	
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	218,013,770円
ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（SMA専用）	407,733,027円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	16,277,188,084円
F O F s用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	12,293,233,113円
F O F s用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンドS（適格機関投資家専用）	562,363,889円

（デリバティブ取引に関する注記）
該当事項はありません。

米国株式LSマザーファンド

貸借対照表

	2023年8月17日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	609,565,561
社債券	22,361,105,508
流動資産合計	22,970,671,069
資産合計	22,970,671,069
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	792,422,400
未払解約金	157,014
未払利息	1,350
流動負債合計	792,580,764
負債合計	792,580,764
純資産の部	
元本等	
元本	20,491,775,268
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,686,315,037
元本等合計	22,178,090,305
純資産合計	22,178,090,305
負債純資産合計	22,970,671,069

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年8月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	20,491,775,268 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.0823 円 (1万口当たり純資産額) (10,823 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年8月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年2月18日
期首元本額	18,894,924,082円
期中追加設定元本額	2,055,998,056円
期中一部解約元本額	459,146,870円
期末元本額	20,491,775,268円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,462,094,500円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,913,062,233円
コア投資戦略ファンド(切替型)	898,365,040円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	267,116,183円
ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	14,770,422,476円
米国株式LSファンド(SMA専用)	213,325,768円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	399,064,145円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	91,092,829円
F O F s用 米国株式LSファンドS(適格機関投資家専用)	477,232,094円

(デリバティブ取引に関する注記)

通貨関連

(2023年8月17日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	21,669,032,000	—	22,461,454,400	△792,422,400
	アメリカドル	21,669,032,000	—	22,461,454,400	△792,422,400
合計		21,669,032,000	—	22,461,454,400	△792,422,400

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

- ①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。
- ②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

コモディティLSアルファ・マザーファンド

貸借対照表

	2023年8月17日現在
--	--------------

項目	金額 (円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	231,541,760
社債券	21,195,934,000
流動資産合計	21,427,475,760
資産合計	21,427,475,760
負債の部	
流動負債	
未払利息	513
流動負債合計	513
負債合計	513
純資産の部	
元本等	
元本	17,427,332,612
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	4,000,142,635
元本等合計	21,427,475,247
純資産合計	21,427,475,247
負債純資産合計	21,427,475,760

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 8月 17日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年 8月 17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	17,427,332,612 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.2295円 (1万口当たり純資産額) (12,295円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年 8月 17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
----------------------------	---

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年 8月 17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月 18日
期首元本額	19,485,803,008円
期中追加設定元本額	799,284,189円
期中一部解約元本額	2,857,754,585円
期末元本額	17,427,332,612円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド (安定型)	1,193,173,131円
コア投資戦略ファンド (成長型)	1,545,396,700円
コア投資戦略ファンド (切替型)	732,422,024円
サテライト投資戦略ファンド (株式型)	222,383,629円
ヘッジファンドSMTBセレクション (SMA専用)	12,683,096,668円
コア投資戦略ファンド (切替型ワイド)	324,710,324円
コア投資戦略ファンド (積極成長型)	74,724,450円
コモディティLSアルファ・ファンド (SMA専用)	173,542,419円
FOFs用 コモディティLSアルファ・ファンドS (適格機関投資家専用)	477,883,267円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

GBCAマザーファンド (ミドルリスク型)

貸借対照表

	2023年 8月 17日現在
項目	金額 (円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,411,528,777
国債証券	11,826,579,460
派生商品評価勘定	279,195,550
未収入金	13,273,871
差入委託証拠金	2,524,259,220
流動資産合計	22,054,836,878
資産合計	22,054,836,878
負債の部	

流動負債	
派生商品評価勘定	124,768,253
前受金	205,726,778
未払金	6,237,572
未払解約金	481,802
未払利息	16,423
流動負債合計	337,230,828
負債合計	337,230,828
純資産の部	
元本等	
元本	18,644,462,294
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	3,073,143,756
元本等合計	21,717,606,050
純資産合計	21,717,606,050
負債純資産合計	22,054,836,878

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段(外貨建先物取引は、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場)によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2023年8月17日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		18,644,462,294 円
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	1.1648 円 (11,648 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年8月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年2月18日
期首元本額	5,483,012,464 円
期中追加設定元本額	13,168,512,087 円
期中一部解約元本額	7,062,257 円
期末元本額	18,644,462,294 円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド (安定型)	475,146,861 円
コア投資戦略ファンド (成長型)	617,507,446 円
分散投資コア戦略ファンドA	2,211,520,094 円
分散投資コア戦略ファンドS	6,265,064,272 円
コア投資戦略ファンド (切替型)	288,321,085 円
サテライト投資戦略ファンド (株式型)	117,442,367 円
ヘッジファンドSMTBセレクション (SMA専用)	8,290,539,600 円

コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	128,875,338 円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	30,544,110 円
SMTAM・FOFs用先進国債券・通貨ターゲットリターン・ファンド（4%目標コース）（適格機関投資家専用）	219,058,326 円
FOFs用 GBCAファンドS（ミドルリスク型）（適格機関投資家専用）	442,795 円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2023年8月17日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	7,373,890,000	—	7,317,000,000	△56,890,000
	売建	12,694,116,815	—	12,431,500,037	262,616,778
合計		20,068,006,815	—	19,748,500,037	205,726,778

（注）1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段（外貨建先物取引は、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場）で評価しております。

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 外貨建先物取引は、計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2023年8月17日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,178,377,215	—	3,174,591,833	△3,785,382
	アメリカドル	571,898,113	—	580,844,474	8,946,361
	カナダドル	580,395,113	—	585,029,658	4,634,545
	スウェーデンクローナ	741,197,858	—	735,579,265	△5,618,593
	ノルウェークローネ	1,284,886,131	—	1,273,138,436	△11,747,695
	売建	4,936,812,639	—	4,984,310,238	△47,497,599
	ユーロ	255,272,457	—	256,128,081	△855,624
	イギリスポンド	1,246,715,640	—	1,267,687,848	△20,972,208
	スイスフラン	2,211,770,307	—	2,239,205,626	△27,435,319
	オーストラリアドル	1,003,468,154	—	1,002,049,855	1,418,299
	ニュージーランドドル	219,586,081	—	219,238,828	347,253
合計		8,115,189,854	—	8,158,902,071	△51,282,981

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

- ①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。
- ②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

貸借対照表

	2023年8月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	100,020,000
社債券	9,175,656,800
流動資産合計	9,275,676,800
資産合計	9,275,676,800
負債の部	
流動負債	
未払金	71,392,000
未払利息	221
流動負債合計	71,392,221
負債合計	71,392,221
純資産の部	
元本等	
元本	10,303,725,374
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	△1,099,440,795
元本等合計	9,204,284,579
純資産合計	9,204,284,579
負債純資産合計	9,275,676,800

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年8月17日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年8月17日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		10,303,725,374 口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	1,099,440,795 円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8933 円 (8,933 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年8月17日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年2月18日
期首元本額	9,300,432,418 円
期中追加設定元本額	1,268,400,319 円
期中一部解約元本額	265,107,363 円
期末元本額	10,303,725,374 円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	591,407,510 円
コア投資戦略ファンド(成長型)	796,654,086 円
コア投資戦略ファンド(切替型)	375,790,307 円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	154,896,295 円
ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	7,052,956,549 円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	168,959,340 円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	37,939,998 円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド(SMA専用)	146,737,936 円
F O F s 用 米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンドS(適格機関投資家専用)	204,506,380 円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド(適格機関投資家専用)	773,876,973 円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

2 【ファンドの現況】

【サテライト投資戦略ファンド（株式型）】

【純資産額計算書】

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	9,025,538,363円
II 負債総額	28,095,569円
III 純資産総額 (I - II)	8,997,442,794円
IV 発行済口数	6,479,566,602口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.3886円
(1万口当たり純資産額)	(13,886円)

(参考)

中小型株式 マザーファンド

純資産額計算書

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	23,863,660,818円
II 負債総額	43,154,361円
III 純資産総額 (I - II)	23,820,506,457円
IV 発行済口数	4,519,929,161口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	5.2701円
(1万口当たり純資産額)	(52,701円)

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	576,561,406,217円
II 負債総額	1,590,814,436円
III 純資産総額 (I - II)	574,970,591,781円
IV 発行済口数	241,335,122,049口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	2.3825円
(1万口当たり純資産額)	(23,825円)

日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

純資産額計算書

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	12,025,213,273円
II 負債総額	7,250,661円
III 純資産総額 (I - II)	12,017,962,612円
IV 発行済口数	9,383,589,153口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.2807円
(1万口当たり純資産額)	(12,807円)

外国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	592,310,603,348円
II 負債総額	2,293,832,264円
III 純資産総額 (I - II)	590,016,771,084円
IV 発行済口数	114,550,350,613口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	5.1507円
(1万口当たり純資産額)	(51,507円)

外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド

純資産額計算書

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	13,032,954,289円
II 負債総額	692,300,131円
III 純資産総額 (I - II)	12,340,654,158円
IV 発行済口数	9,107,891,113口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.3549円
(1万口当たり純資産額)	(13,549円)

新興国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	159,043,288,680円
II 負債総額	583,678,641円
III 純資産総額 (I - II)	158,459,610,039円
IV 発行済口数	41,313,395,771口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	3.8356円
(1万口当たり純資産額)	(38,356円)

J-REITインデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	136,974,341,622円
II 負債総額	6,184,315,938円
III 純資産総額 (I - II)	130,790,025,684円
IV 発行済口数	61,317,202,195口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	2.1330円
(1万口当たり純資産額)	(21,330円)

グローバルREITインデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	91,442,750,369円
II 負債総額	447,010,548円
III 純資産総額 (I - II)	90,995,739,821円
IV 発行済口数	36,635,994,237口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	2.4838円
(1万口当たり純資産額)	(24,838円)

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

（2023年9月29日現在）

I 資産総額	30,895,726,850円
II 負債総額	2,024,740,894円
III 純資産総額（I－II）	28,870,985,956円
IV 発行済口数	24,311,380,040口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.1876円
（1万口当たり純資産額）	（11,876円）

ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド

純資産額計算書

（2023年9月29日現在）

I 資産総額	29,915,771,301円
II 負債総額	96,445,677円
III 純資産総額（I－II）	29,819,325,624円
IV 発行済口数	28,992,864,475口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.0285円
（1万口当たり純資産額）	（10,285円）

米国株式LSマザーファンド

純資産額計算書

（2023年9月29日現在）

I 資産総額	21,665,535,402円
II 負債総額	685,352,091円
III 純資産総額（I－II）	20,980,183,311円
IV 発行済口数	19,023,740,651口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.1028円
（1万口当たり純資産額）	（11,028円）

コモディティLSアルファ・マザーファンド

純資産額計算書

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	20,322,183,899円
II 負債総額	1,891,374,305円
III 純資産総額 (I - II)	18,430,809,594円
IV 発行済口数	15,308,023,125口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.2040円
(1万口当たり純資産額)	(12,040円)

GBCAマザーファンド (ミドルリスク型)

純資産額計算書

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	22,217,893,485円
II 負債総額	1,237,014,601円
III 純資産総額 (I - II)	20,980,878,884円
IV 発行済口数	17,787,647,062口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.1795円
(1万口当たり純資産額)	(11,795円)

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

純資産額計算書

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	9,217,305,331円
II 負債総額	923,591,868円
III 純資産総額 (I - II)	8,293,713,463円
IV 発行済口数	9,229,484,107口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	0.8986円
(1万口当たり純資産額)	(8,986円)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換等

該当事項はありません。

(2) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限

該当事項はありません。

(4) 振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

① 受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合又は当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

② 受益権の譲渡

イ. 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

ロ. 上記イ. の申請のある場合には、上記イ. の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ. の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。

ハ. 上記イ. の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

③ 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載又は記録によらなければ、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

④ 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

⑤ 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。

⑥ 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2023年9月29日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

会社が取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。

取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。

また、監査等委員以外取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

監査等委員である取締役の任期は、選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。

取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。

取締役会を招集するには、各取締役に對して会日の3日前までに招集通知を發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手續を経ずに取締役会を開催することができます。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

②投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

運用企画部担当役員を委員長とする運用・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部において、ファンドマネージャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定しま

す。

[DO (実行)]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の執行、ファンドの運用状況管理を行います。

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

売買発注の執行は、各運用部からの運用の実行指図に基づき、各運用部から独立したトレーディング部のトレーダーが行います。

[CHECK (検証・評価)]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。

このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立した運用監理部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN-DO-CHECK の PDC サイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は 2023 年 11 月 17 日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2 【事業の内容及び営業の概況】

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

2023 年 9 月 29 日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	530	14,341,707
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	67	215,927
単位型公社債投資信託	51	169,297
合計	648	14,726,931

3 【委託会社等の経理状況】

(1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 38 年大蔵省令第 59 号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第 2 条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成 19 年内閣府令第 52 号）により作成しております。

なお、財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(2) 委託者は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、当事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2023年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第37期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は

集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R Lデータは監査の対象には含まれていません。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	21,675	23,067
金銭の信託	14,913	14,693
前払費用	166	198
未収委託者報酬	9,067	9,147
未収運用受託報酬	6,252	5,815
未収収益	179	176
短期差入証拠金	2,528	3,541
その他	2,363	1,566
流動資産合計	57,146	58,207
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1 289	※1 255
器具備品	※1 687	※1 560
有形固定資産合計	976	816
無形固定資産		
ソフトウェア	6,292	7,203
その他	31	40
無形固定資産合計	6,324	7,244
投資その他の資産		
投資有価証券	6,607	4,063
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	907	1,181
その他	31	31
投資その他の資産合計	13,182	10,911
固定資産合計	20,482	18,972
資産合計	77,629	77,179

(単位：百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	47	49
未払金	8,285	7,174
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,561	4,586
その他未払金	3,723	2,588
未払費用	1,049	1,089
未払法人税等	504	726
賞与引当金	578	613
その他	1,958	303
流動負債合計	12,423	9,958
固定負債		
退職給付引当金	820	904
資産除去債務	153	153
その他	12	27
固定負債合計	986	1,086
負債合計	13,410	11,044
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	500	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	41,948	44,755
利益剰余金合計	44,548	47,355
株主資本合計	63,788	66,595
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	941	49
繰延ヘッジ損益	△509	△510
評価・換算差額等合計	431	△460
純資産合計	64,219	66,134
負債・純資産合計	77,629	77,179

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	41,730	40,724
運用受託報酬	11,883	10,918
その他営業収益	390	351
営業収益合計	54,004	51,993
営業費用		
支払手数料	20,567	20,123
広告宣伝費	286	307
公告費	—	2
調査費	5,567	5,309
調査費	1,062	1,104
委託調査費	4,487	4,191
図書費	17	13
営業雑経費	5,201	5,842
通信費	68	77
印刷費	454	419
協会費	55	58
諸会費	35	38
情報機器関連費	4,473	5,153
その他営業雑経費	112	94
営業費用合計	31,622	31,585
一般管理費		
給料	6,295	6,451
役員報酬	249	318
給料・手当	5,072	5,144
賞与	972	987
退職給付費用	254	252
福利費	632	671
交際費	3	7
旅費交通費	20	122
租税公課	327	289
不動産賃借料	323	327
寄付金	5	—
減価償却費	989	1,698
業務委託費	1,081	1,277
諸経費	1,301	1,454
一般管理費合計	11,234	12,553
営業利益	11,147	7,854

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業外収益		
受取利息	2	57
収益分配金	16	4
投資有価証券売却益	0	738
投資有価証券償還益	219	121
デリバティブ利益	—	565
その他	8	11
営業外収益合計	247	1,499
営業外費用		
金銭の信託運用損	332	158
投資有価証券売却損	0	16
為替差損	291	1,227
デリバティブ費用	1,191	—
その他	33	32
営業外費用合計	1,848	1,435
経常利益	9,545	7,918
特別損失		
退職給付費用	120	—
特別損失合計	120	—
税引前当期純利益	9,425	7,918
法人税、住民税及び事業税	3,403	2,350
法人税等調整額	△465	119
法人税等合計	2,937	2,470
当期純利益	6,487	5,448

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	—	—	—
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			△2,797	△2,797	△2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	—	—	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	791	△65	726	60,824
当期変動額				
剰余金の配当				△2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	149	△444	△295	△295
当期変動額合計	149	△444	△295	3,394
当期末残高	941	△509	431	64,219

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	—	—	—
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当期変動額					
剰余金の配当			△2,641	△2,641	△2,641
当期純利益			5,448	5,448	5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	—	—	2,807	2,807	2,807
当期末残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	941	△509	431	64,219
当期変動額				
剰余金の配当				△2,641
当期純利益				5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	△891	△0	△891	△891
当期変動額合計	△891	△0	△891	1,915
当期末残高	49	△510	△460	66,134

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。)

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

6. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。

過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理

数理計算上の差異 : 各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当事業年度末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

7. 収益及び費用の計上基準

当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の内容及び当履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

(1) 投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(2) 投資一任業務

当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(3) 投資助言業務

当社は、投資顧問（助言）契約に基づき投資助言サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(4) 成功報酬

当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資一任契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いと合理的に判断した時点で収益を認識しております。

8. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

(4) ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

9. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下、「時価算定会計基準適用指針」という。)を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過措置に代って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。これによる財務諸表への影響はありません。

なお、「金融商品関係」注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27-3項に従って、前事業年度に係るものについては記載していません。

(表示方法の変更)

(貸借対照表関係)

前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めていた「短期差入証拠金」は、金額的重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた4,891百万円は、「短期差入証拠金」2,528百万円、「その他」2,363百万円として組み替えております。

(貸借対照表関係)

※1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2022年3月31日)		当事業年度 (2023年3月31日)	
建物	146	百万円	184	百万円
器具備品	535	〃	681	〃
計	681	〃	866	〃

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自2021年4月1日至2022年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	3,000	—	—	3,000

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の 種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,641	利益剰余金	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

当事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	—	—	3,000

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,641	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2023年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の 種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月22日 定時株主総会	普通 株式	3,367	利益剰余金	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

(リース取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針8. ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリー毎に管理しております。

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）第24-16項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（(1) *2、*3 及び (注2) 参照）。

また、金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債
前事業年度 (2022年3月31日)

区 分	貸借対照表計上額 (百万円) (*1、*2)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*3)	—	196	—	196
資産計	—	196	—	196
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(1,333)	(80)	—	(1,413)
ヘッジ会計が適用されているもの	—	(71)	—	(71)
デリバティブ取引計	(1,333)	(151)	—	(1,485)

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 投資有価証券のうち、投資信託 (貸借対照表計上額 6,474 百万円) 及び組合出資金等 (貸借対照表計上額 133 百万円) は上記に含めておりません。

(*3) 金銭の信託の信託財産のうち、投資信託 (貸借対照表計上額 13,876 百万円) 及び組合出資金等 (貸借対照表計上額 840 百万円) は上記に含めておりません。これらも含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は 14,913 百万円であります。

(*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度 (2023年3月31日)

区 分	貸借対照表計上額 (百万円) (*1)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,029	12,703	—	13,733
投資有価証券(*3)				
その他有価証券	—	3,844	—	3,844
資産計	1,029	16,547	—	17,577
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(10)	(48)	—	(58)
ヘッジ会計が適用されているもの	—	(88)	—	(88)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	—	(147)

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等 (貸借対照表計上額は 960 百万円) は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は 14,693 百万円であります。

(*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等 (貸借対照表計上額 218 百万円) は上記に含めておりません。

(*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未払金は、短期間 (1 年以内) で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注 1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル 1 の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル 2 の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル 2 の時価に分類しております。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル 2 の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル 1 の時価に分類しております。為替予約の時価は、為替レート等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル 2 の時価に分類しております。

(注 2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
投資有価証券	0	0
関係会社株式	5,636	5,636

(注 3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度 (2022年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,675	—	—	—
未収委託者報酬	9,067	—	—	—
未収運用受託報酬	6,252	—	—	—
投資有価証券 投資信託	—	108	1,712	0

当事業年度 (2023年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,067	—	—	—
未収委託者報酬	9,147	—	—	—
未収運用受託報酬	5,815	—	—	—
投資有価証券 投資信託	—	594	2,144	38

(有価証券関係)

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
子会社株式	5,636	5,636

2. その他有価証券

前事業年度 (2022年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,888	3,403	1,485
小計	4,888	3,403	1,485
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,585	1,711	△126
小計	1,585	1,711	△126
合計	6,474	5,115	1,358

当事業年度 (2023年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	986	622	364
小計	986	622	364
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,857	3,150	△292
小計	2,857	3,150	△292
合計	3,844	3,772	71

非上場株式及び組合出資金等は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」に含めておりません。
 なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非上場株式	0	0
組合出資金等	133	218

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位:百万円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位:百万円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	3,429	738	16

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度 (2022年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,498	—	△54	△54
	英ポンド	277	—	△1	△1
	カナダドル	111	—	△1	△1
	スイスフラン	139	—	△2	△2
	香港ドル	190	—	△1	△1
	ユーロ	676	—	△18	△18
	買建 ユーロ	21	—	0	0
	合計	6,915	—	△80	△80

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度 (2023年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,923	—	△21	△21
	英ポンド	256	—	△6	△6
	カナダドル	109	—	△1	△1
	スイスフラン	163	—	△2	△2
	香港ドル	202	—	△0	△0
	ユーロ	651	—	△19	△19
	買建 米ドル	152	—	3	3
	合計	7,458	—	△48	△48

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

(2) 株式関連

前事業年度 (2022年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	17,197	—	△1,333	△1,333
合計		17,197	—	△1,333	△1,333

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度 (2023年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	12,195	—	△9	△9
	債券先物取引 売建	182	—	△0	△0
合計		12,378	—	△10	△10

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度 (2022年3月31日)

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		4,422	—	△43
	英ポンド		3,297	—	△21
	スイスフラン		79	—	△1
	香港ドル		119	—	△1
	ユーロ		125	—	△3
	人民元		13	—	△0
合計			8,057	—	△71

当事業年度 (2023年3月31日)

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,729	—	△6
	英ポンド		3,228	—	△81
	スイスフラン		20	—	△0
	香港ドル		83	—	△0
	ユーロ	21	—	△0	
合計			5,082	—	△88

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	626	820
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
数理計算上の差異の発生額	—	6
退職給付の支払額	△81	△57
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	120	—
その他	18	—
退職給付債務の期末残高	820	911

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	820	911
未認識数理計算上の差異	—	△6
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904
退職給付引当金	820	904
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	120	—
その他	18	—
確定給付制度に係る退職給付費用	274	142

(5) 年金資産に関する事項

該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
割引率	0.4%	0.4%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度 100 百万円、当事業年度 109 百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2022年3月31日)		当事業年度 (2023年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	112	百万円	58	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	177	〃	187	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	251	〃	277	〃
税務上の収益認識差額	74	〃	—	〃
税務上の費用認識差額	439		412	
繰延ヘッジ損益	224	〃	225	〃
その他	76	〃	75	〃
繰延税金資産 合計	1,357	〃	1,236	〃
繰延税金負債				
有価証券評価差額	△415	〃	△21	〃
その他	△34	〃	△32	〃
繰延税金負債 合計	△450	〃	△54	〃
繰延税金資産の純額	907	〃	1,181	〃

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の 100 分の 5 以下であるため、注記を省略しております。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」(実務対応報告第 42 号 2021 年 8 月 12 日)に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針 7. 収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,395 百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,395 百万円

(*) 当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載していません。

当事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,887 百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	10,090	未収運用受託報酬	5,421
							投信販売代行手数料等	9,701	未払手数料	1,995

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

① 運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

② 投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	—	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,593	未収運用受託報酬	5,271
							投信販売代行手数料等	9,445	未払手数料	2,029

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

① 運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

② 投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2022 年 3 月 31 日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2023 年 3 月 31 日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1 株当たり情報)

	前事業年度 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	当事業年度 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
1 株当たり純資産額	21,406,512 円 22 銭	22,044,962 円 63 銭
1 株当たり当期純利益金額	2,162,405 円 20 銭	1,816,227 円 49 銭

(注) 1. 潜在株式調整後 1 株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1 株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	当事業年度 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
当期純利益	6,487 百万円	5,448 百万円
普通株主に帰属しない金額	—	—
普通株式に係る当期純利益	6,487 百万円	5,448 百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000 株	3,000 株

4 【利害関係人との取引制限】

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

(1) 自己又はその役員との取引

自己又はその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2) 運用財産相互間の取引

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(3) 通常の見取条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の見取条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4) 親法人等又は子法人等の利益を因るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を因るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5) その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5 【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

2023年11月17日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

追加型証券投資信託
サテライト投資戦略ファンド（株式型）
（愛称：サテラップ（株式型））
投資信託約款

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

運用の基本方針

投資信託約款第 19 条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

別に定める投資信託証券（以下「投資対象ファンド」といいます。）を主要投資対象とします。このほか、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等に直接投資する場合があります。

(2) 投資態度

①主として、日本を含む先進国及び新興国の株式、株式代替資産*¹及びその他の様々な資産並びにヘッジファンドを実質的な投資対象とする投資対象ファンド*²に分散投資します。

*1：この投資信託において、株式代替資産とは、不動産投資信託証券（REIT）、マスター・リミテッド・パートナーシップ（MLP）、転換社債（CB）、その他上場有価証券、その他委託会社が株式と一定程度の類似性があると判断する資産等を指します。

*2：ヘッジファンドを実質的な投資対象とする投資対象ファンドとは、実質的に金利、債券、株式、リート、為替、コモディティ等に対する裁定取引やデリバティブ取引等を積極的に活用するファンド、又は各種ヘッジファンド指数に概ね連動する投資成果を目標とするファンドを指します。

②各資産及び各投資対象ファンドへの配分比率は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の相関係数、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。各資産及び各投資対象ファンドへの配分比率は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて変更を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。

③投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、投資対象ファンドとして定められていた投資信託証券が投資対象ファンドから除外されること、もしくは新たな投資信託証券が投資対象ファンドとして定められることがあります。

④投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

⑤この投資信託では原則として為替ヘッジを行いません。ただし、外貨建資産について為替ヘッジを行う投資信託証券を組み入れる場合があります。

⑥資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 運用制限

①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

②株式への直接投資は行いません。

③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

④デリバティブの直接利用は行いません。

⑤一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3. 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。

- (1) 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- (2) 分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- (3) 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託
サテライト投資戦略ファンド（株式型）
（愛称：サテラップ（株式型））
投資信託約款

（信託の種類、委託者及び受託者）

第1条 この信託は、証券投資信託であり、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。

②この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

（信託事務の委託）

第2条 受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本条、第18条第1項、第18条第2項及び第23条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

（信託の目的及び金額）

第3条 委託者は、金300億円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

（信託金の限度額）

第4条 委託者は、受託者と合意のうえ、金3,000億円を限度として信託金を追加することができます。

②委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

（信託期間）

第5条 この信託の期間は、投資信託契約締結日から平成38年2月17日までとします。

（受益権の取得申込みの勧誘の種類）

第6条 この信託に係る受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

（当初の受益者）

第7条 この投資信託契約締結当初及び追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第8条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

（受益権の分割及び再分割）

第8条 委託者は、第3条による受益権については300億口を上限として、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、受託者と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

（追加信託の価額及び口数、基準価額の計算方法）

第9条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

②この投資信託約款において基準価額とは、投資信託財産に属する資産（第20条に規定する借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口

数で除した金額をいいます。

③投資信託財産に属する外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。））、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

④第 22 条に規定する為替予約の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

（信託日時異なる受益権の内容）

第 10 条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

（受益権の帰属と受益証券の不発行）

第 11 条 この信託の全ての受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第 2 条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第 2 条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

②委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合又は当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

③委託者は、第 8 条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。

（受益権の設定に係る受託者の通知）

第 12 条 受託者は、この投資信託契約締結により生じた受益権については信託設定時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

（受益権の申込単位及び価額）

第 13 条 販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第 28 条第 1 項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及び委託者の指定する金融商品取引法第 2 条第 11 項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第 8 条第 1 項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、販売会社が定める申込単位をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。ただし、販売会社と別に定める自動引き落とし投資契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に係る収益分配金の再投資の場合は、1 円以上 1 円単位をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。

②前項の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金（第 4 項又は第 6 項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引換えに、当該口座

に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。

- ③第1項の規定にかかわらず、ニューヨーク証券取引所もしくはロンドン証券取引所の休業日又はニューヨークもしくはロンドンの銀行休業日においては、取得の申込みは受け付けないものとします。
- ④第1項の受益権の価額は、取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に、手数料並びに当該手数料に係る消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この投資信託契約締結日前の取得申込みに係る当該価額は、1口につき1円に手数料及び当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ⑤前項の手数料の額は、販売会社が別に定めるところによるものとします。
- ⑥第4項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第31条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑦前各項の規定にかかわらず、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、委託者は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

（受益権の譲渡に係る記載又は記録）

第14条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

- ②前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、前項の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。
- ③委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（受益権の譲渡の対抗要件）

第15条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載又は記録によらなければ、委託者及び受託者に対抗することができません。

（投資の対象とする資産の種類）

第16条 この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. 金銭債権
 - ハ. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

（運用の指図範囲等）

第17条 委託者は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券に投資するほか、次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. コマーシャル・ペーパー及び短期社債等
2. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前号の証券の性質を有するもの
3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）
4. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、第3号の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができます。

②委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

③第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前項に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（利害関係人等との取引等）

第18条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、投資信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）及び受託者の利害関係人、第23条第1項に定める信託業務の委託先及びその利害関係人又は受託者における他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等並びに第20条、第22条及び第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

②受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者又は受託者の利害関係人の計算で行うことができます。

なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

③委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、投資信託財産と、委託者、その取締役、執行役及び委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項及び同条第4項に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）又は委託者が運用の指図を行う他の投資信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等並びに第20条、第22条及び第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等並びに当該取引、当該行為を行うことができます。

④前3項の場合、委託者及び受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項及び同法第32条第3項の通知は行いません。

(運用の基本方針)

第 19 条 委託者は、投資信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行います。

(公社債の借入れの指図、目的及び範囲)

第 20 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

②前項の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

③投資信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

④第 1 項の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第 21 条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

(外国為替予約取引の指図、目的及び範囲)

第 22 条 委託者は、投資信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

(信託業務の委託等)

第 23 条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第 22 条第 1 項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準の全てに適合する者（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される投資信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

②受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③前各項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者及び委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

1. 投資信託財産の保存に係る業務
2. 投資信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用又は改良を目的とする業務
3. 委託者のみの指図により投資信託財産の処分及びその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

(混蔵寄託)

第 24 条 金融機関又は第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第 28 条第 1 項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及び外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した

外国において発行された譲渡性預金証書又はコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

(投資信託財産の登記等及び記載等の留保等)

第 25 条 信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

②前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者又は受託者が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

③投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図)

第 26 条 委託者は、投資信託財産に属する投資信託証券に係る投資信託契約の一部解約の請求及び投資信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第 27 条 委託者は、前条の規定による一部解約代金及び売却代金、有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(資金の借入れ)

第 28 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

②一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が 5 営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の 10%を超えないこととします。

③収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

④借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

(損益の帰属)

第 29 条 委託者の指図に基づく行為により投資信託財産に生じた利益及び損失は、全て受益者に帰属します。

(受託者による資金の立替え)

第 30 条 投資信託財産に属する有価証券について、借替えがある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②投資信託財産に属する有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて投資信託財産に繰り入れることができます。

③前 2 項の立替金の決済及び利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第 31 条 この信託の計算期間は、毎年 2 月 18 日から翌年 2 月 17 日までとするを原則とします。ただし、第 1 計算期間は、平成 27 年 6 月 16 日から平成 28 年 2 月 17 日までとします。

②前項の規定にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、第 5 条に定める信託期間の終了日とします。

(投資信託財産に関する報告等)

第 32 条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

②受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③受託者は、前 2 項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第 37 条第 3 項に定める報告は行わないこととします。

④受益者は、受託者に対し、信託法第 37 条第 2 項に定める書類又は電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報及び当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第 38 条第 1 項に定める閲覧又は謄写の請求をすることはできないものとします。

(信託事務の諸費用)

第 33 条 投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。

②投資信託財産の監査費用及び当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、毎計算期間の最初の 6 ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

(信託報酬等の総額及び支弁の方法)

第 34 条 委託者及び受託者の信託報酬の総額は、第 31 条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年 10,000 分の 148 の率を乗じて得た額とします。

②前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の 6 ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のとき投資信託財産中から支弁するものとし、委託者及び受託者間の配分は別に定めます。

③第 1 項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

(収益の分配方式)

第 35 条 投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子及びこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金

額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

(収益分配金、償還金及び一部解約金の支払い)

第 36 条 収益分配金は、毎計算期間終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に支払います。

②前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、第 11 条第 3 項の規定にしたがい、振替口座簿に記載又は記録されます。

③償還金（信託終了時における投資信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）は、信託終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

④一部解約金（第 39 条第 4 項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）は、第 39 条第 1 項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、7 営業日目から当該受益者に支払います。

⑤第 1 項、第 3 項及び第 4 項に規定する収益分配金、償還金及び一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとしします。

⑥収益分配金、償還金及び一部解約金に係る収益調整金は、原則として、各受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとしします。

(収益分配金、償還金及び一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責)

第 37 条 受託者は、収益分配金については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金については第 36 条第 3 項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第 36 条第 4 項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

②受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金及び一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

(収益分配金及び償還金の時効)

第 38 条 受益者が、収益分配金については第 36 条第 1 項に規定する支払開始日から 5 年間その支払いを請求しないとき、並びに信託終了による償還金については第 36 条第 3 項に規定する支払開始日から 10 年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(投資信託契約の一部解約)

第 39 条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に対し販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

- ②受益者が前項の一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- ③委託者は、第 1 項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。なお、第 1 項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。
- ④前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌々営業日の基準価額とします。
- ⑤委託者は、ニューヨーク証券取引所もしくはロンドン証券取引所の休業日又はニューヨークもしくはロンドンの銀行休業日の場合は、第 1 項による一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。
- ⑥委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、第 1 項による一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。
- ⑦前項により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、第 4 項の規定に準じて計算された価額とします。

(質権口記載又は記録の受益権の取扱い)

第 40 条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、この投資信託約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

(投資信託契約の解約)

第 41 条 委託者は、信託期間中において、この投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、又はやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ②委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が 30 億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ③委託者は、前 2 項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに投資信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の 2 週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- ④前項の書面決議において、受益者（委託者及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ⑤第 3 項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の 3 分の 2 以上に当たる多数をもつ

て行います。

⑥第3項から前項までの規定は、委託者が投資信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第3項から前項までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

(投資信託契約に関する監督官庁の命令)

第42条 委託者は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

②委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの投資信託約款の変更をしようとするときは、第46条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第43条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

②前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第46条の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡及び承継に伴う取扱い)

第44条 委託者は、事業の全部又は一部を譲渡することがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②委託者は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任及び解任に伴う取扱い)

第45条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者又は受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、又は裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第46条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

②委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

(投資信託約款の変更等)

第46条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるとき又はやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更すること又はこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更又は併合しようとする旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この投資信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

②委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款の変更等の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③前項の書面決議において、受益者（委託者及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

④第2項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

⑤書面決議の効力は、この信託の全ての受益者に対してその効力を生じます。

⑥第2項から前項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

⑦前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

（信託期間の延長）

第47条 委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者にとって有利であると認めるときは、受託者と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

（他の受益者の氏名等の開示の請求の制限）

第48条 この信託の受益者は、委託者又は受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

1. 他の受益者の氏名又は名称及び住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

（運用報告書に記載すべき事項の提供）

第49条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。この場合において、委託者は、運用報告書を交付したものとみなします。

②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

（公告）

第50条 委託者が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

（投資信託約款に関する疑義の取扱い）

第51条 この投資信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

（付則）

第1条 第36条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本の差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「各受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

上記条項により投資信託契約を締結します。

投資信託契約締結日 平成 27 年 6 月 16 日

委託者 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

受託者 三井住友信託銀行株式会社

1. 別に定める投資信託証券

投資信託約款第 17 条第 1 項に定める「別に定める投資信託証券」とは、次の投資信託の受益証券又は投資証券（振替受益権又は振替投資口を含みます。）をいいます。

追加型証券投資信託 FOFs 用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）

親投資信託 中小型株式 マザーファンド

親投資信託 国内株式インデックス マザーファンド

親投資信託 日本株式 ESG セレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

追加型証券投資信託 国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）

追加型証券投資信託 日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）

追加型証券投資信託 FOFs 用国内株式 EVI バリューファンド（適格機関投資家専用）

親投資信託 外国株式インデックス マザーファンド

親投資信託 外国株式 ESG リーダーズインデックスマザーファンド

親投資信託 新興国株式インデックス マザーファンド

追加型証券投資信託 グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）

追加型証券投資信託 ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）

追加型証券投資信託 ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式ファンド（FOFs 用）（適格機関投資家専用）

追加型証券投資信託 世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）

外国籍円建投資信託証券 Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL

親投資信託 J-REIT インデックス マザーファンド

親投資信託 グローバル REIT インデックス マザーファンド

親投資信託 ゴールド マザーファンド（為替ヘッジあり）

外国籍円建投資信託証券 BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラス S-JPY

親投資信託 ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド

追加型証券投資信託 FOFs 用 MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）

親投資信託 米国株式 LS マザーファンド

親投資信託 コモディティ LS アルファ・マザーファンド

親投資信託 GBCA マザーファンド（ミドルリスク型）

追加型証券投資信託 ノムラ FOFs 用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）

追加型証券投資信託 ウェスタン・カレンシー・アルファ・ファンド S（適格機関投資家専用）

外国籍円建投資信託証券 MA Hedge Fund Strategies Limited

外国籍円建投資信託証券 MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR

親投資信託 米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド